공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

포커스농산물모(채권-파생평)

1. 계약금액

(단위:USD 백만)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	8	0	8	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

* 해당펀드는 위험지표산출에 어려움이 있어 공시하지 않음

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

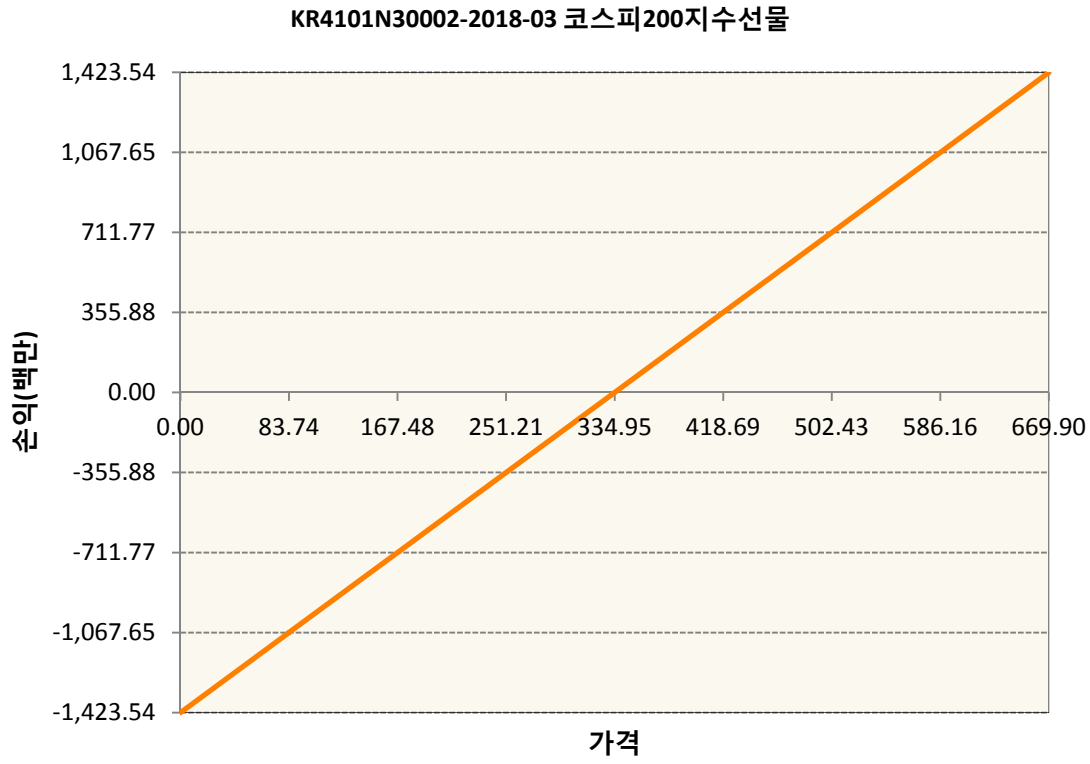
스마트인덱스모

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,424	0	1,424	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							113
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-113	-113	-113	-113	-113	-113	-113
-5.33%	-76	-76	-76	-76	-76	-76	-76
-2.67%	-38	-38	-38	-38	-38	-38	-38
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	38	38	38	38	38	38	38
5.33%	76	76	76	76	76	76	76
8.00%	113	113	113	113	113	113	113

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

69

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

SMART합성-MSCI선진국증권상장지

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	13,365	0	13,365	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWMXWO0(신한MXWO 미래S171122	1,158

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

358

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

SMART중국본토중소형CSI500상장

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	지수	스왑	4,901	0	4,901	장외

2. 만기시점의 손익구조

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

SWCSI50000 신한CSI500미래S171208	415

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

367

* 일부 리스크 팩터의 경우 추정에 어려움이 있어 대용치가 사용되었음

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

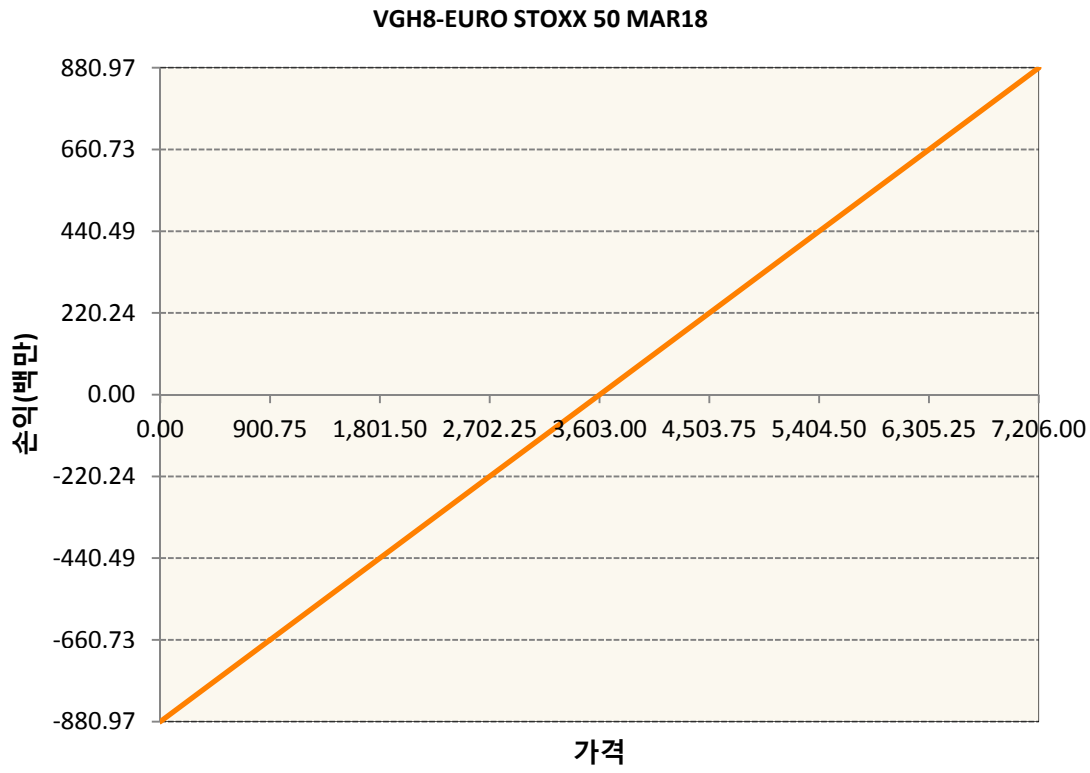
유로인덱스모(주식-파생형)

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	881	0	881	

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

VGH8	EURO STOXX 50 MAR18	70

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)

(단위:백만원)

39

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

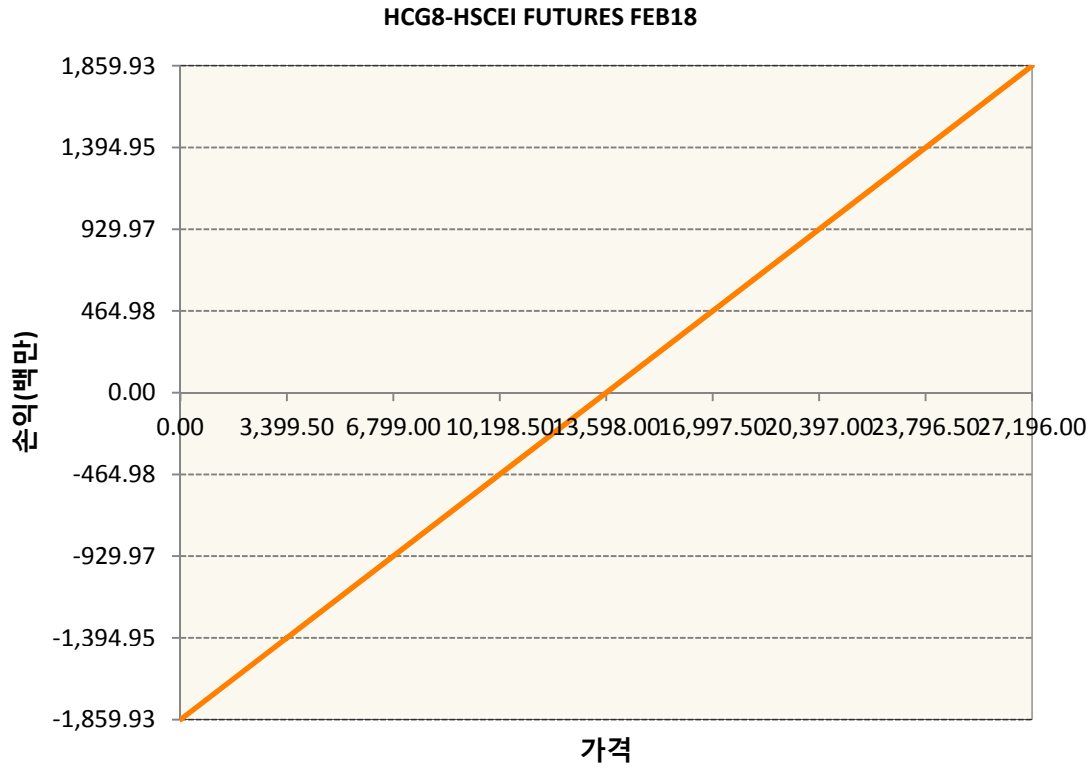
차이나인덱스모(주식-파생형)

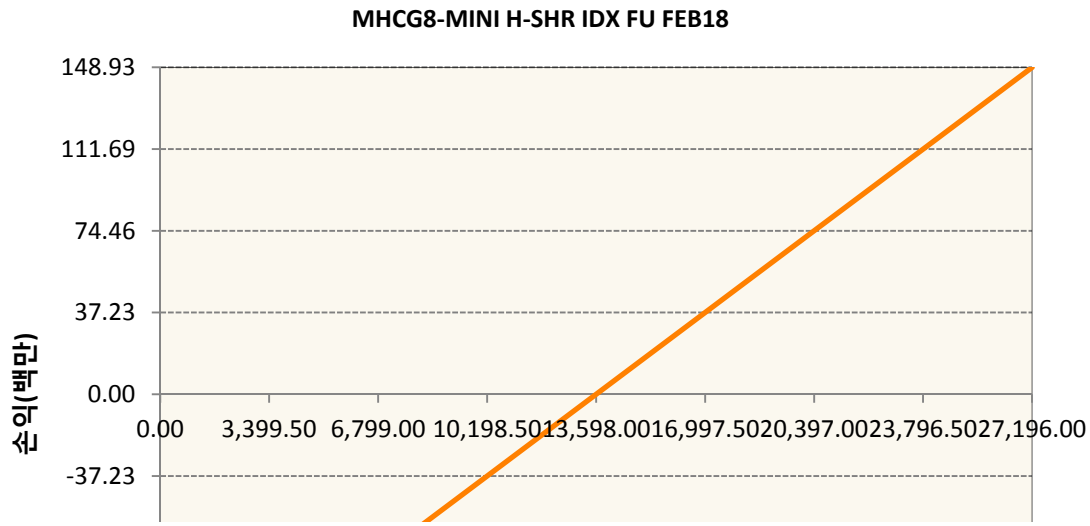
1. 계약금액

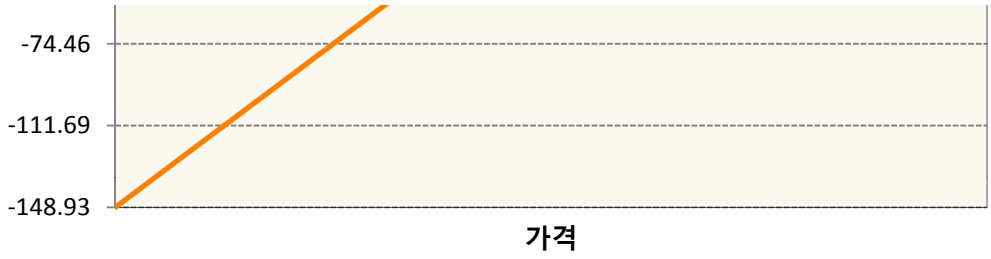
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	2,009	0	2,009	장내

2. 만기시점의 손익구조







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	149
MHCG8	MINI H-SHR IDX FU FEB18	12

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	130

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

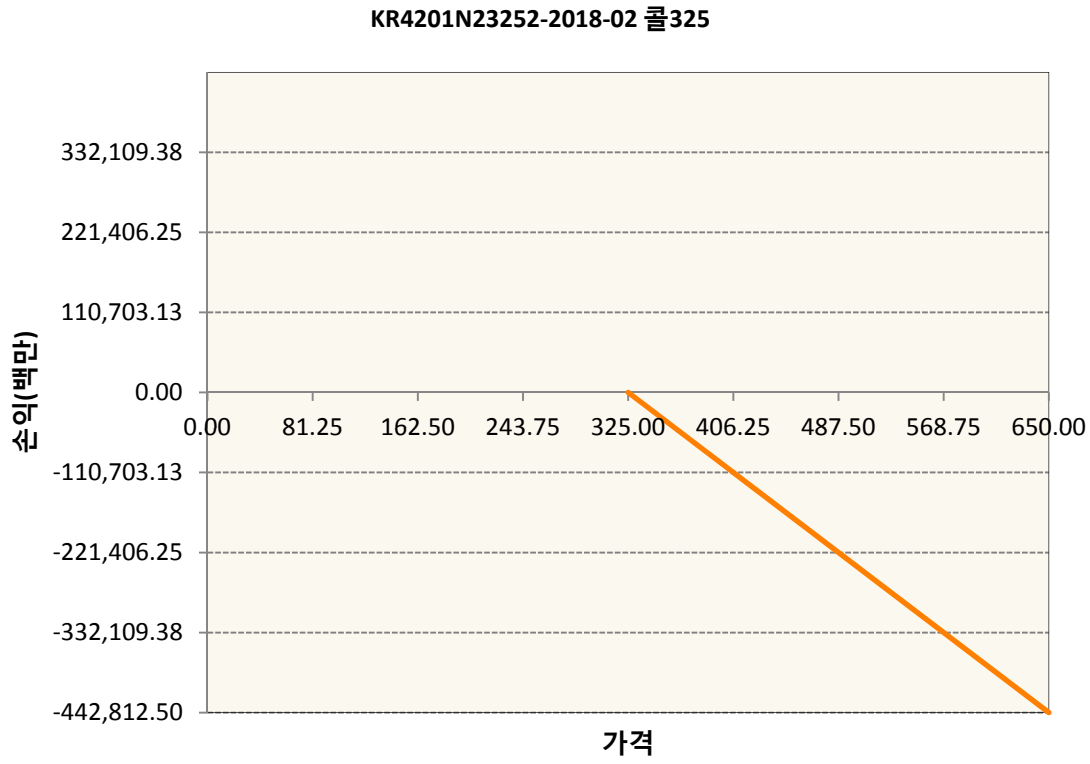
커버드콜모(주식혼합-파생형)

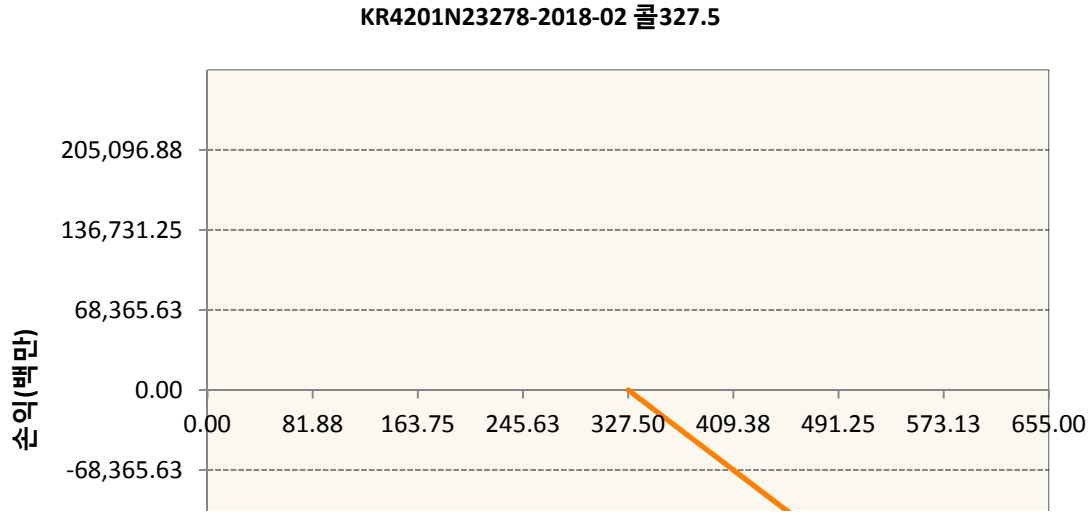
1. 계약금액

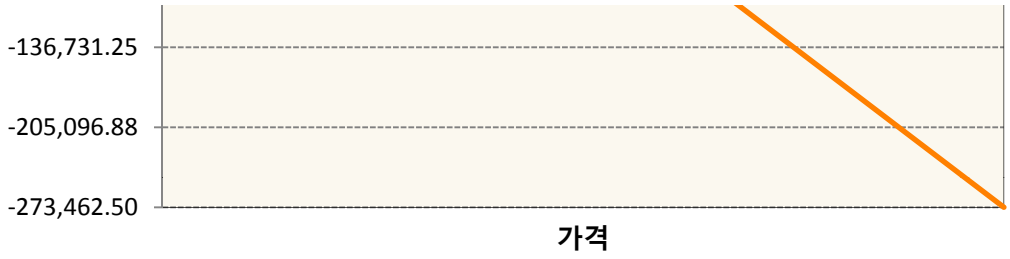
(단위:백만원)

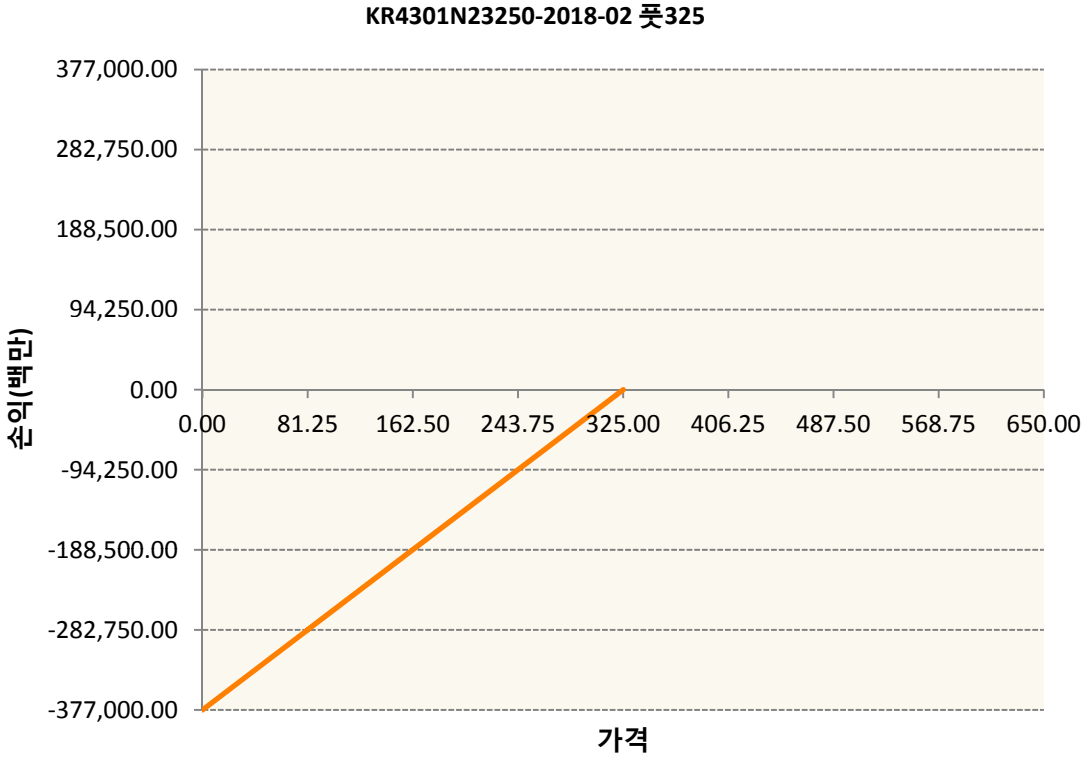
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	옵션	0	1,217,561	-1,217,561	장내

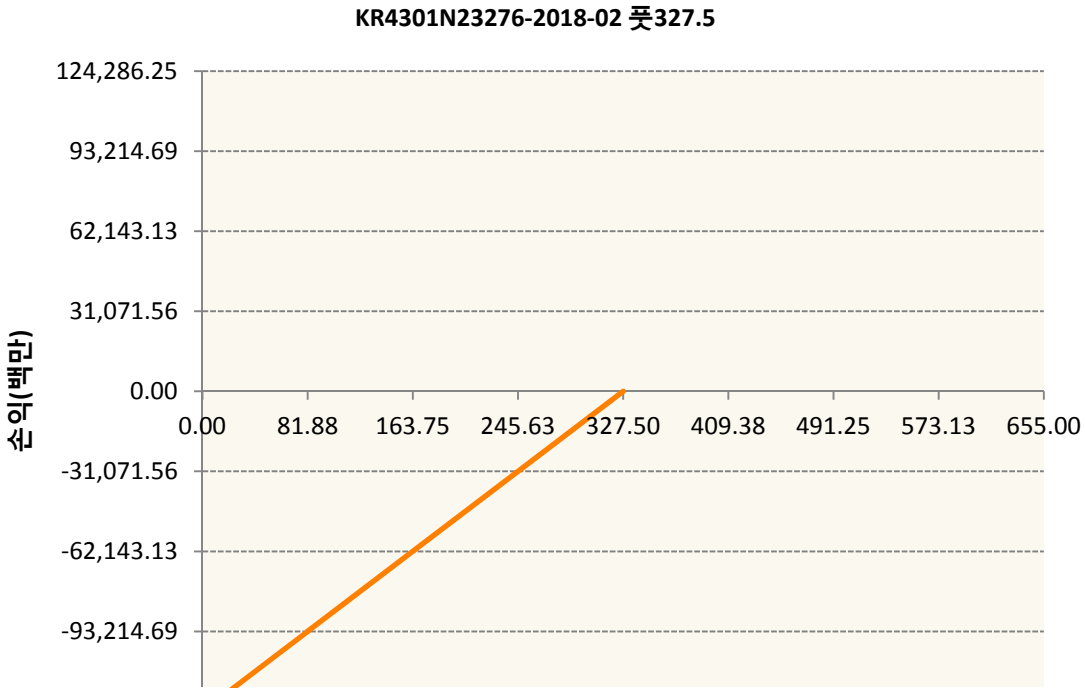
2. 만기시점의 손익구조






-136,731.25
-205,096.88
-273,462.50
가격


KR4301N23250-2018-02 풋325
377,000.00
282,750.00
188,500.00
94,250.00
0.00
-94,250.00
-188,500.00
-282,750.00
-377,000.00
0.00
81.25
162.50
243.75
325.00
406.25
487.50
568.75
650.00
손익(백만)
가격


KR4301N23276-2018-02 풋327.5
124,286.25
93,214.69
62,143.13
31,071.56
0.00
-31,071.56
-62,143.13
-93,214.69
0.00
81.88
163.75
245.63
327.50
409.38
491.25
573.13
655.00
손익(백만)



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4201N232 2018-02 콜325							33,907
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	13,945	13,858	13,737	13,582	13,394	13,176	12,929
-5.33%	13,049	12,704	12,329	11,928	11,508	11,071	10,620
-2.67%	9,309	8,750	8,191	7,632	7,073	6,514	5,955
0%	1,258	864	442	0	-460	-933	-1,418
2.67%	-9,740	-9,870	-10,040	-10,248	-10,491	-10,765	-11,068
5.33%	-21,688	-21,709	-21,748	-21,808	-21,894	-22,006	-22,146
8.00%	-33,786	-33,787	-33,793	-33,804	-33,825	-33,858	-33,907
KR4201N232 2018-02 콜327.5							20,217
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	7,096	7,064	7,016	6,949	6,863	6,759	6,638
-5.33%	6,769	6,608	6,425	6,221	6,001	5,767	5,521
-2.67%	5,104	4,775	4,443	4,110	3,775	3,438	3,101
0%	902	610	309	0	-315	-634	-957
2.67%	-5,464	-5,583	-5,729	-5,898	-6,087	-6,293	-6,515
5.33%	-12,697	-12,721	-12,761	-12,818	-12,893	-12,987	-13,100
8.00%	-20,101	-20,103	-20,110	-20,122	-20,143	-20,174	-20,217
KR4301N232 2018-02 풋325							20,735
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-20,681	-20,682	-20,685	-20,690	-20,699	-20,714	-20,735
-5.33%	-10,453	-10,513	-10,592	-10,688	-10,800	-10,927	-11,067
-2.67%	-2,222	-2,489	-2,756	-3,024	-3,291	-3,559	-3,827
0%	317	231	124	0	-140	-294	-461
2.67%	460	457	451	440	422	395	358
5.33%	461	461	461	461	460	458	455
8.00%	461	461	461	461	461	461	461
KR4301N232 2018-02 풋327.5							7,572
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-7,564	-7,564	-7,565	-7,565	-7,566	-7,569	-7,572
-5.33%	-4,199	-4,207	-4,219	-4,237	-4,259	-4,286	-4,318
-2.67%	-1,174	-1,250	-1,328	-1,408	-1,489	-1,571	-1,654
0%	168	117	61	0	-64	-132	-202
2.67%	299	296	290	282	269	252	231

5.33%	301	301	301	300	300	298	296
8.00%	301	301	301	301	301	301	301

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

86,258

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

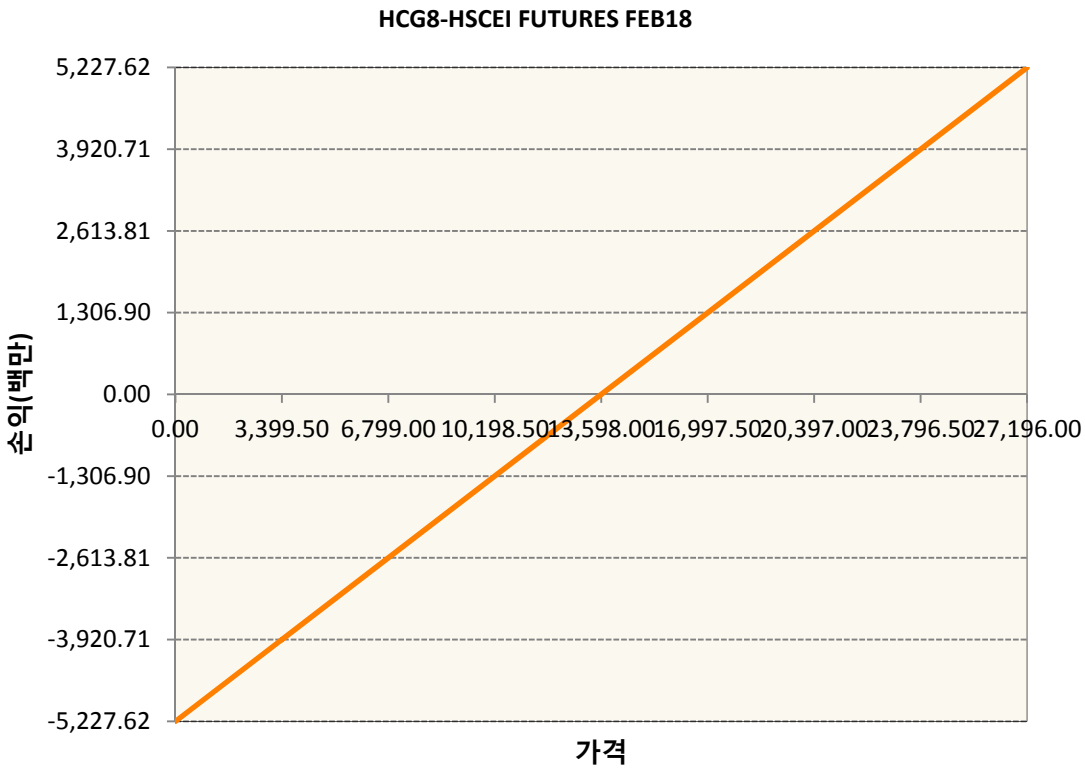
홍콩H커버드콜모(주식혼합-파생

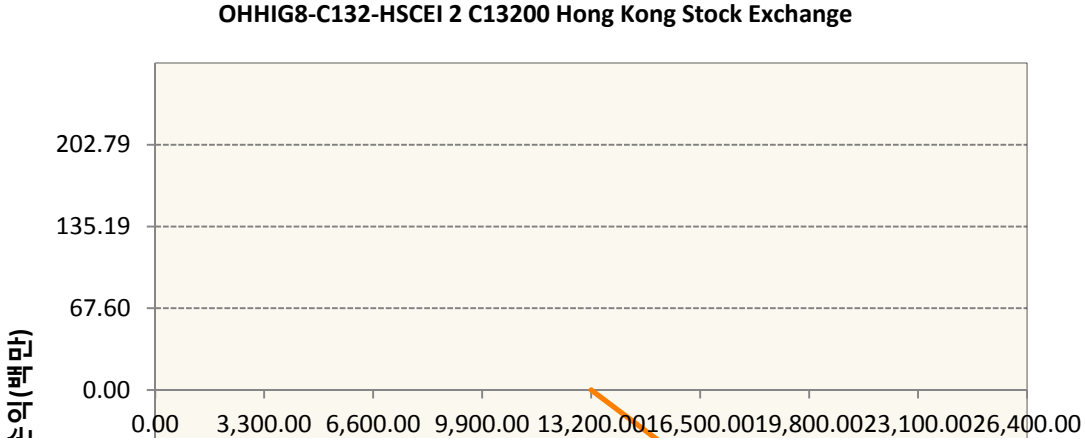
1. 계약금액

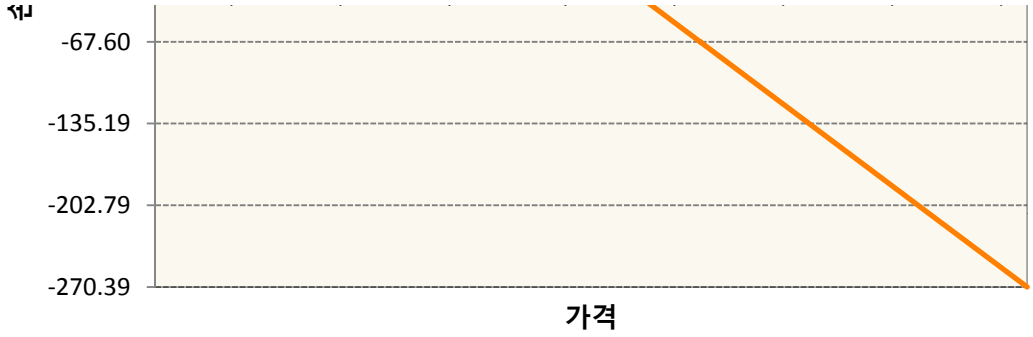
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	5,228	0	5,228	장내
누계	유가증권	옵션	0	11,703	-11,703	장내

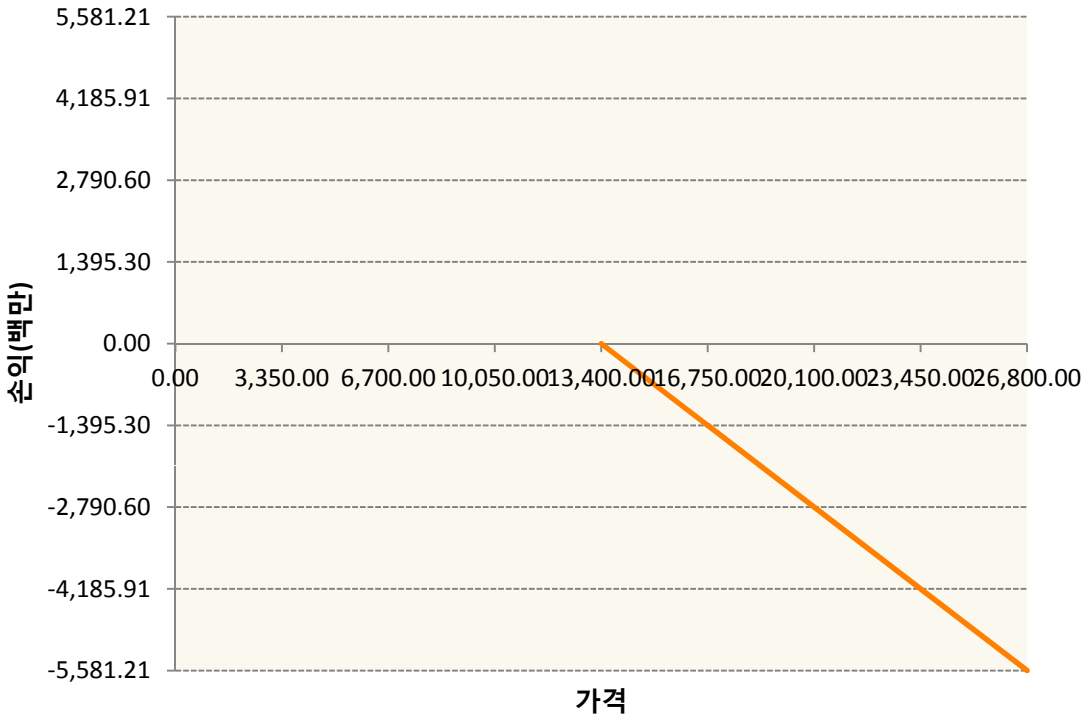
2. 만기시점의 손익구조



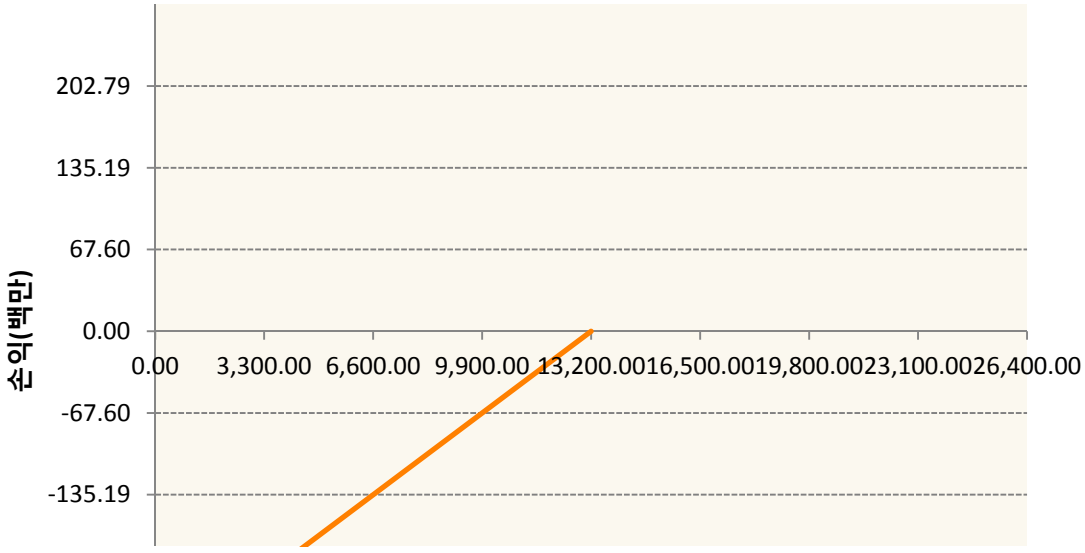


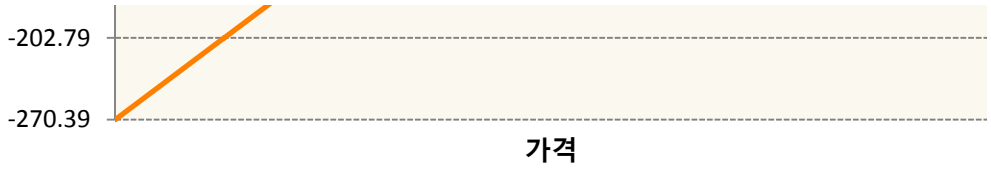


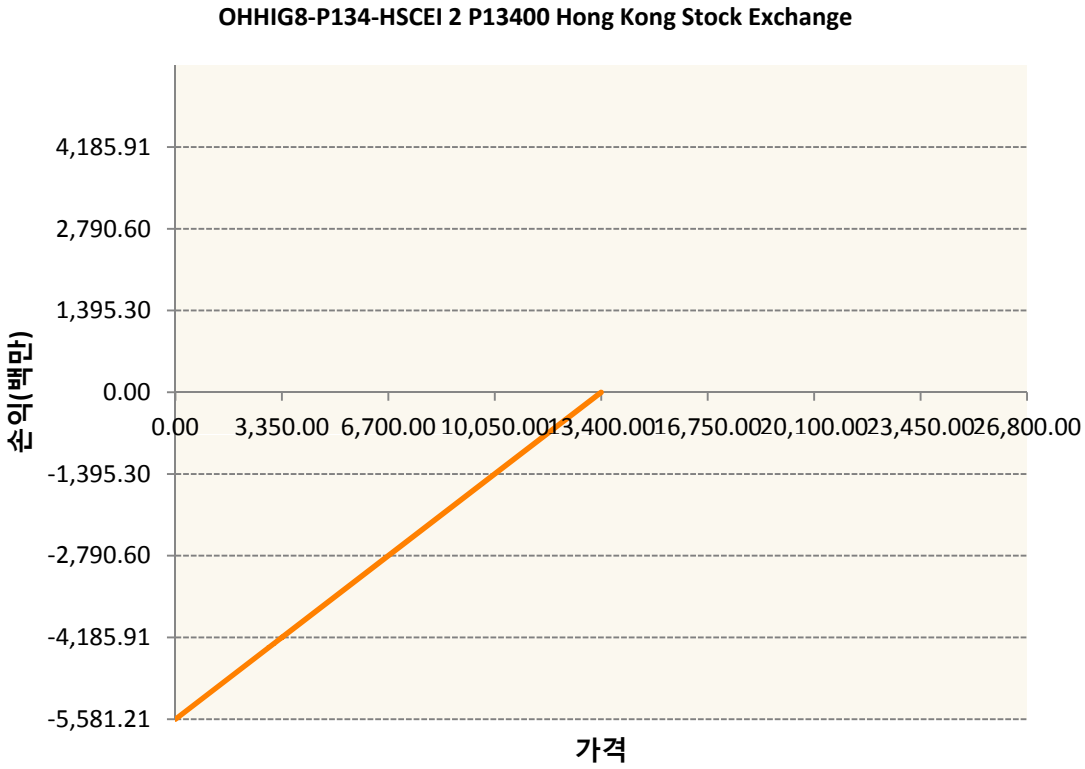
OHHIG8-C134-HSCEI 2 C13400 Hong Kong Stock Exchange



OHHIG8-P132-HSCEI 2 P13200 Hong Kong Stock Exchange







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
HCG8	HSCEI FUTURES FEB18	418
OHHIG8-C13	HSCEI 2 C13200 Hong Kong Stock Exchange	22
OHHIG8-C13	HSCEI 2 C13400 Hong Kong Stock Exchange	446
OHHIG8-P13	HSCEI 2 P13200 Hong Kong Stock Exchange	22
OHHIG8-P13	HSCEI 2 P13400 Hong Kong Stock Exchange	446

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)
	1,095

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

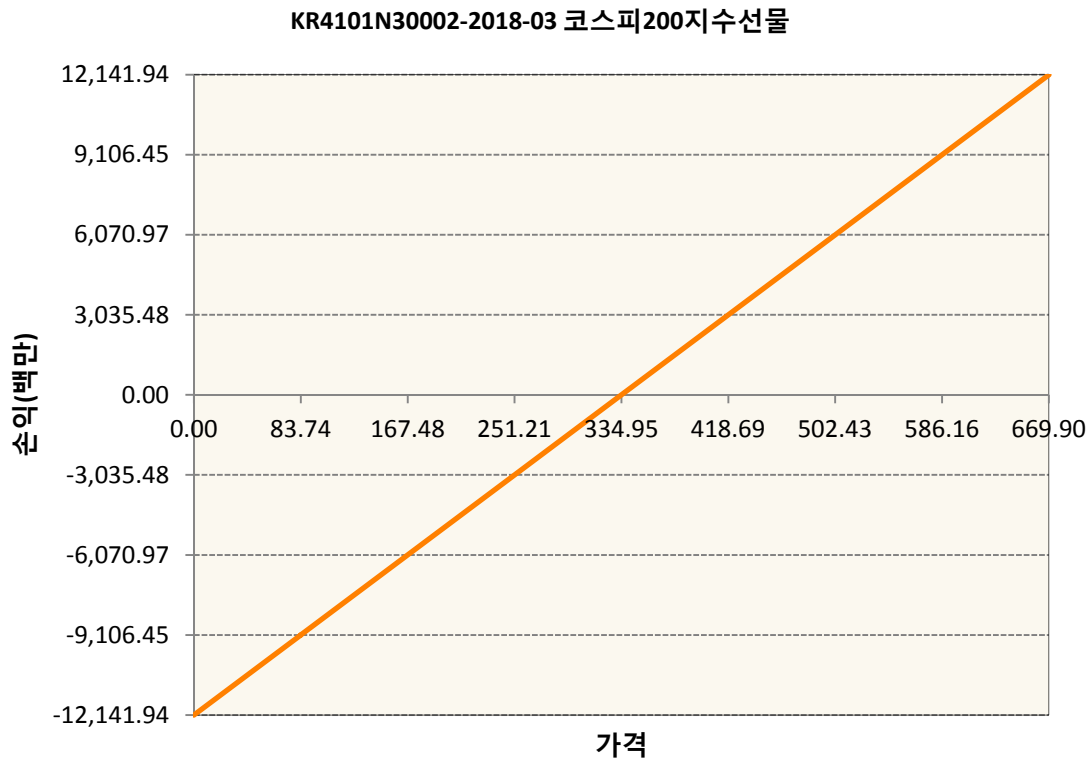
코리아듀얼엔진커버드콜(주식혼

1. 계약금액

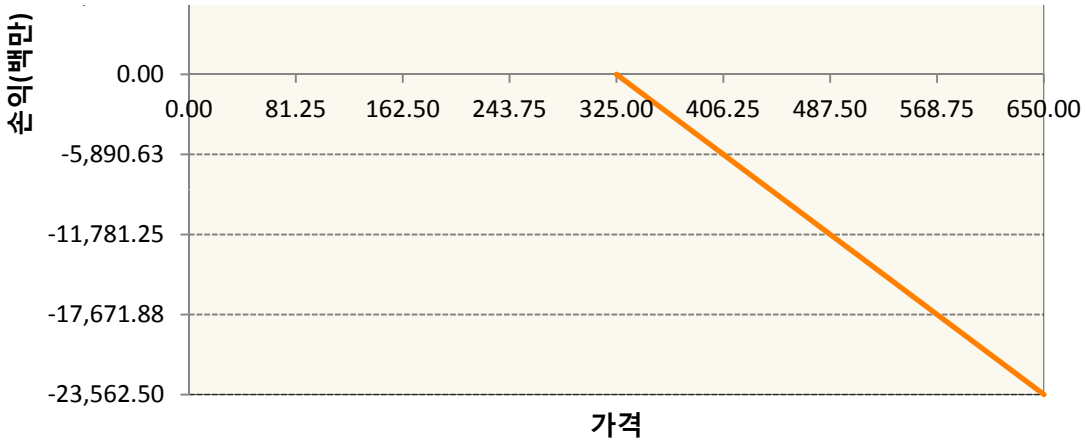
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	12,142	0	12,142	장내
누계	유가증권	스왑	60,200	0	60,200	장외
누계	유가증권	옵션	0	60,250	-60,250	장내

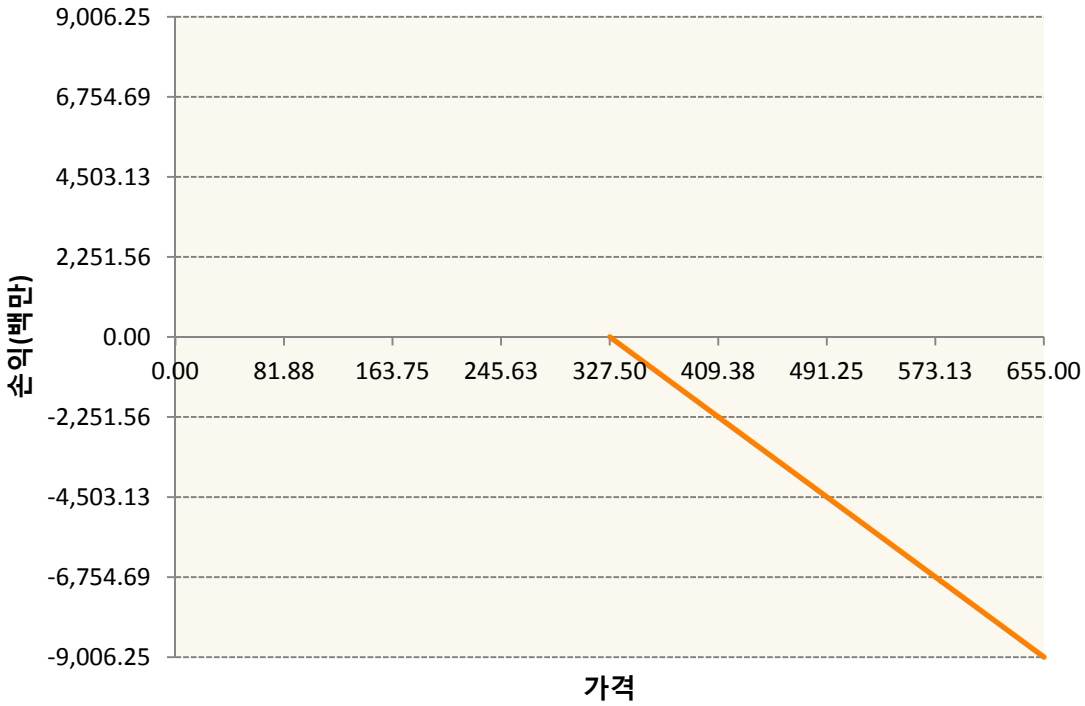
2. 만기시점의 손익구조



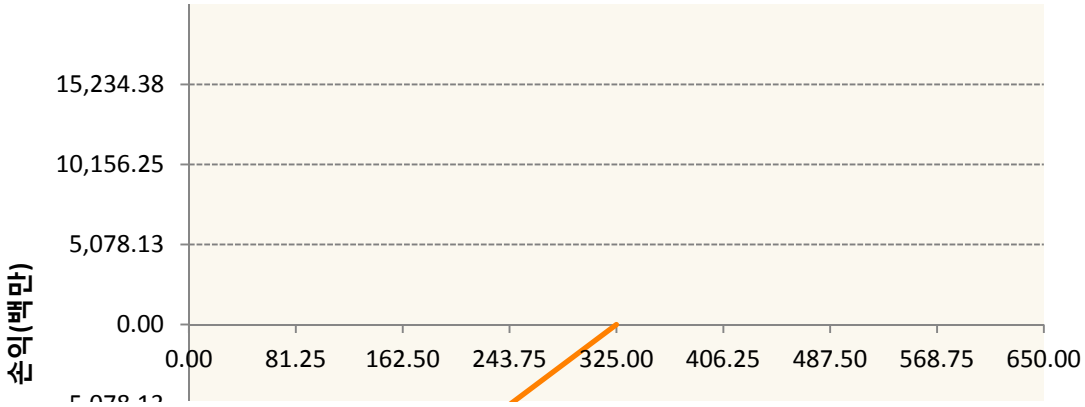




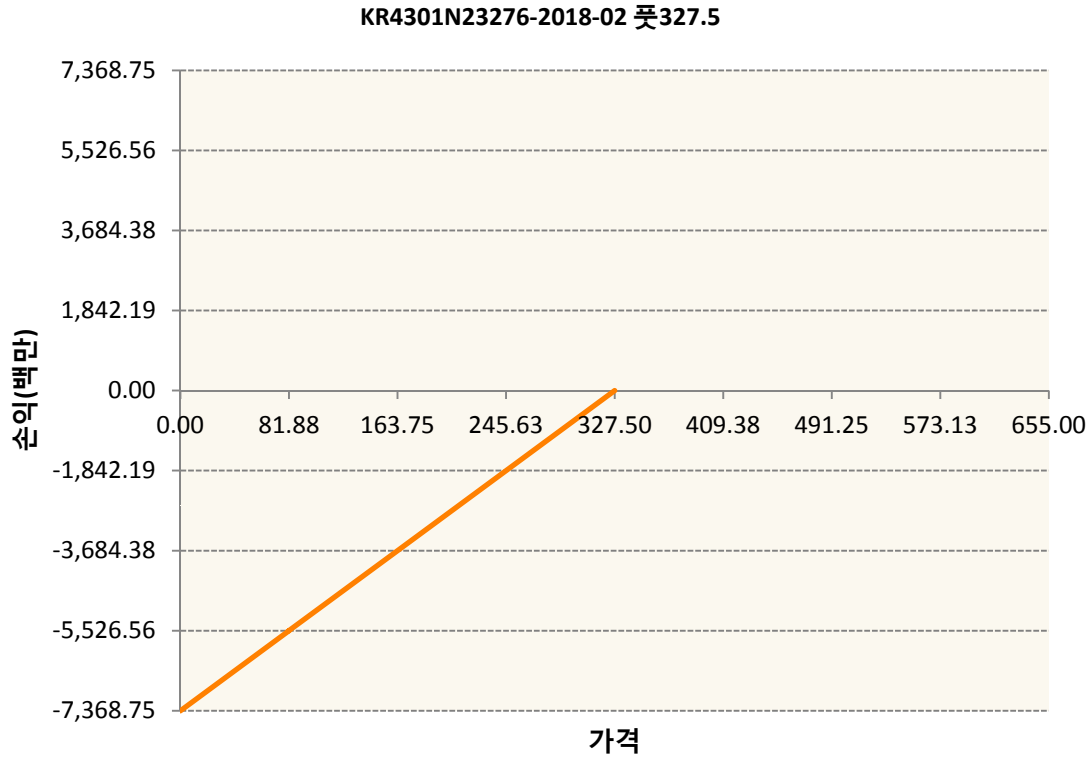
KR4201N23278-2018-02 콜327.5



KR4301N23250-2018-02 풋325







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_2							1,452
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452	-1,452
-5.33%	-968	-968	-968	-968	-968	-968	-968
-2.67%	-484	-484	-484	-484	-484	-484	-484
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	484	484	484	484	484	484	484
5.33%	968	968	968	968	968	968	968
8.00%	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452	1,452
2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_3							275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%

-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_4						157
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-5.33%	-105	-105	-105	-105	-105	-105	-105
-2.67%	-52	-52	-52	-52	-52	-52	-52
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	52	52	52	52	52	52	52
5.33%	105	105	105	105	105	105	105
8.00%	157	157	157	157	157	157	157
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_5						235
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-235	-235	-235	-235	-235	-235	-235
-5.33%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
-2.67%	-78	-78	-78	-78	-78	-78	-78
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	78	78	78	78	78	78	78
5.33%	157	157	157	157	157	157	157
8.00%	235	235	235	235	235	235	235
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_6						196
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-196	-196	-196	-196	-196	-196	-196
-5.33%	-131	-131	-131	-131	-131	-131	-131
-2.67%	-65	-65	-65	-65	-65	-65	-65
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	65	65	65	65	65	65	65
5.33%	131	131	131	131	131	131	131
8.00%	196	196	196	196	196	196	196
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_7						251
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-251	-251	-251	-251	-251	-251	-251
-5.33%	-167	-167	-167	-167	-167	-167	-167
-2.67%	-84	-84	-84	-84	-84	-84	-84
0%	0	0	0	0	0	0	0

2.67%	84	84	84	84	84	84	84
5.33%	167	167	167	167	167	167	167
8.00%	251	251	251	251	251	251	251
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_8						465
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-465	-465	-465	-465	-465	-465	-465
-5.33%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-2.67%	-155	-155	-155	-155	-155	-155	-155
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	155	155	155	155	155	155	155
5.33%	310	310	310	310	310	310	310
8.00%	465	465	465	465	465	465	465
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_9						310
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-310	-310	-310	-310	-310	-310	-310
-5.33%	-206	-206	-206	-206	-206	-206	-206
-2.67%	-103	-103	-103	-103	-103	-103	-103
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	103	103	103	103	103	103	103
5.33%	206	206	206	206	206	206	206
8.00%	310	310	310	310	310	310	310
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_10						275
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-275	-275	-275	-275	-275	-275	-275
-5.33%	-183	-183	-183	-183	-183	-183	-183
-2.67%	-92	-92	-92	-92	-92	-92	-92
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	92	92	92	92	92	92	92
5.33%	183	183	183	183	183	183	183
8.00%	275	275	275	275	275	275	275
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_11						628
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-628	-628	-628	-628	-628	-628	-628
-5.33%	-419	-419	-419	-419	-419	-419	-419
-2.67%	-209	-209	-209	-209	-209	-209	-209
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	209	209	209	209	209	209	209
5.33%	419	419	419	419	419	419	419
8.00%	628	628	628	628	628	628	628
	2.529E+11 UBCSFXC1 INDEX_12						471

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-471	-471	-471	-471	-471	-471	-471
-5.33%	-314	-314	-314	-314	-314	-314	-314
-2.67%	-157	-157	-157	-157	-157	-157	-157
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	157	157	157	157	157	157	157
5.33%	314	314	314	314	314	314	314
8.00%	471	471	471	471	471	471	471
	KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물						967

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-967	-967	-967	-967	-967	-967	-967
-5.33%	-645	-645	-645	-645	-645	-645	-645
-2.67%	-322	-322	-322	-322	-322	-322	-322
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	322	322	322	322	322	322	322
5.33%	645	645	645	645	645	645	645
8.00%	967	967	967	967	967	967	967
	KR4201N232 2018-02 콜325						1,804

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	742	737	731	723	713	701	688
-5.33%	694	676	656	635	612	589	565
-2.67%	495	466	436	406	376	347	317
0%	67	46	24	0	-24	-50	-75
2.67%	-518	-525	-534	-545	-558	-573	-589
5.33%	-1,154	-1,155	-1,157	-1,160	-1,165	-1,171	-1,178
8.00%	-1,798	-1,798	-1,798	-1,799	-1,800	-1,802	-1,804
	KR4201N232 2018-02 콜327.5						666

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	234	233	231	229	226	223	219
-5.33%	223	218	212	205	198	190	182
-2.67%	168	157	146	135	124	113	102
0%	30	20	10	0	-10	-21	-32
2.67%	-180	-184	-189	-194	-200	-207	-215
5.33%	-418	-419	-420	-422	-425	-428	-431
8.00%	-662	-662	-662	-663	-663	-664	-666
	KR4301N232 2018-02 풋325						1,117

	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,114	-1,114	-1,114	-1,115	-1,115	-1,116	-1,117
-5.33%	-563	-566	-571	-576	-582	-589	-596

-2.67%	-120	-134	-149	-163	-177	-192	-206
0%	17	12	7	0	-8	-16	-25
2.67%	25	25	24	24	23	21	19
5.33%	25	25	25	25	25	25	25
8.00%	25	25	25	25	25	25	25
	KR4301N232 2018-02 풋327.5						449
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-448	-448	-448	-449	-449	-449	-449
-5.33%	-249	-249	-250	-251	-253	-254	-256
-2.67%	-70	-74	-79	-83	-88	-93	-98
0%	10	7	4	0	-4	-8	-12
2.67%	18	18	17	17	16	15	14
5.33%	18	18	18	18	18	18	18
8.00%	18	18	18	18	18	18	18

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

9,486

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

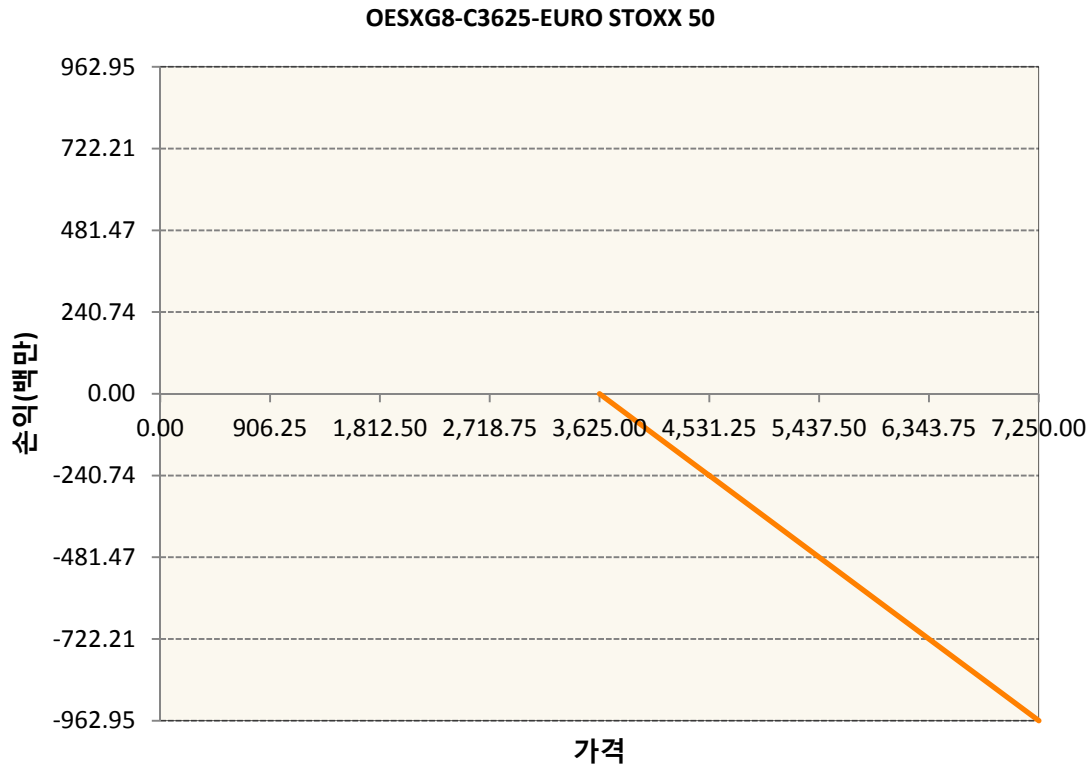
유로커버드콜모(주식혼합-파생형

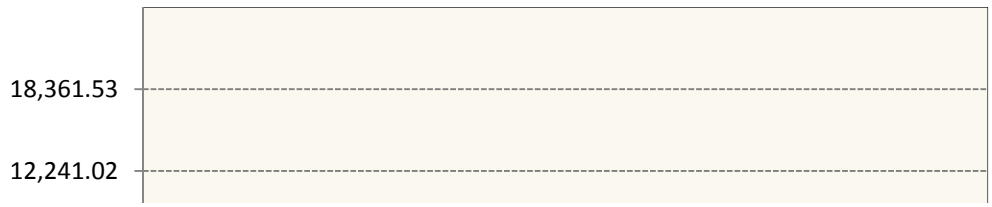
1. 계약금액

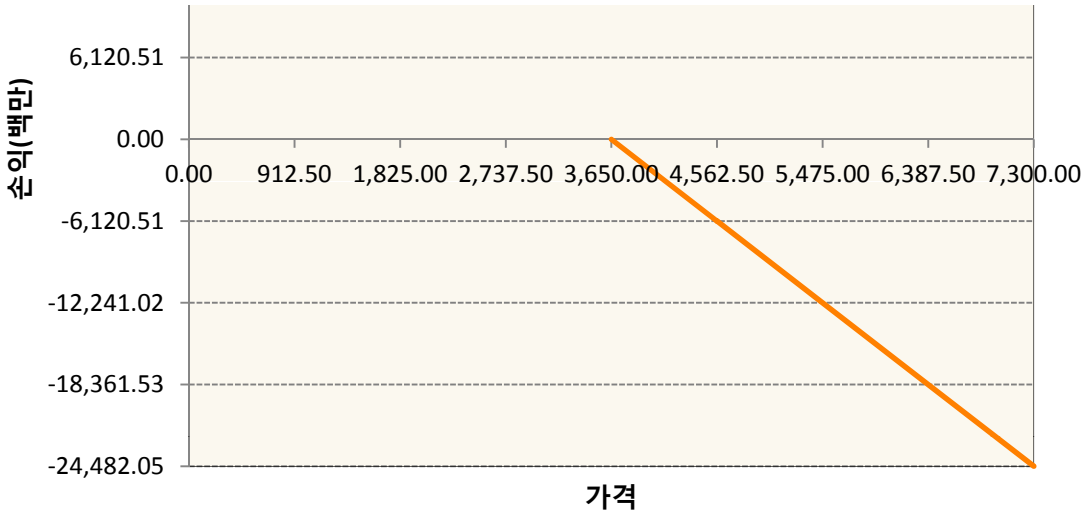
(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
신규	유가증권	스왑	0	0	0	장외
신규	유가증권	옵션	0	0	0	장내
신규	지수	스왑	0	0	0	장외
누계	유가증권	선물	16,068	0	16,068	
누계	유가증권	스왑	99,615	0	99,615	장외
누계	유가증권	옵션	0	50,890	-50,890	장내
누계	지수	스왑	53,129	0	53,129	장외

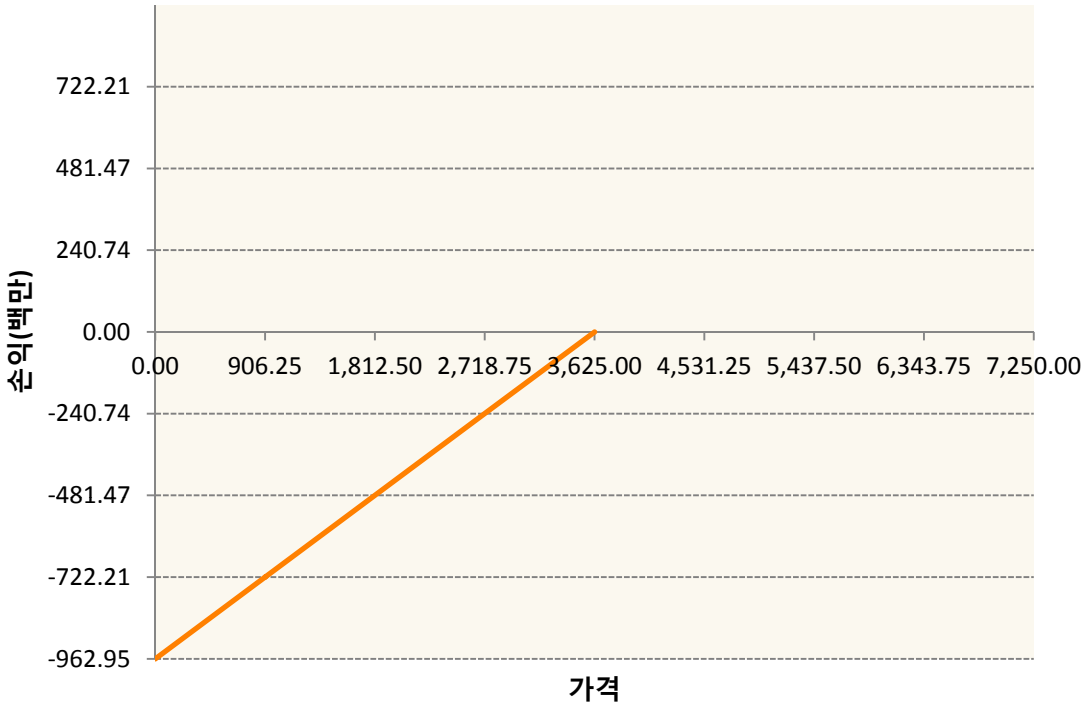
2. 만기시점의 손익구조



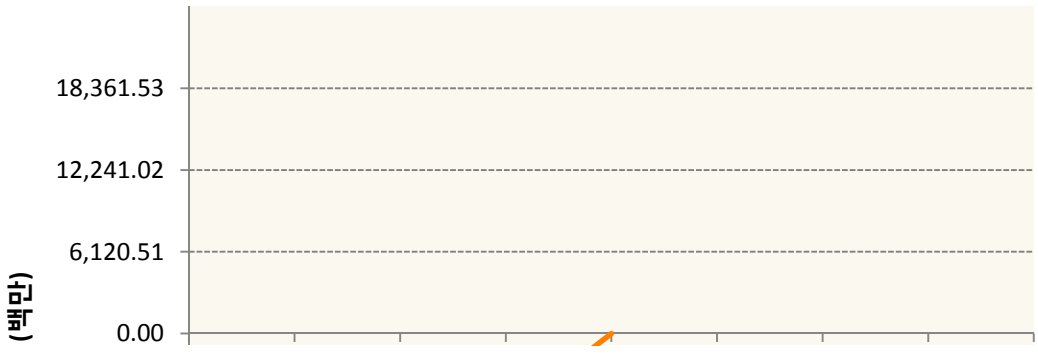


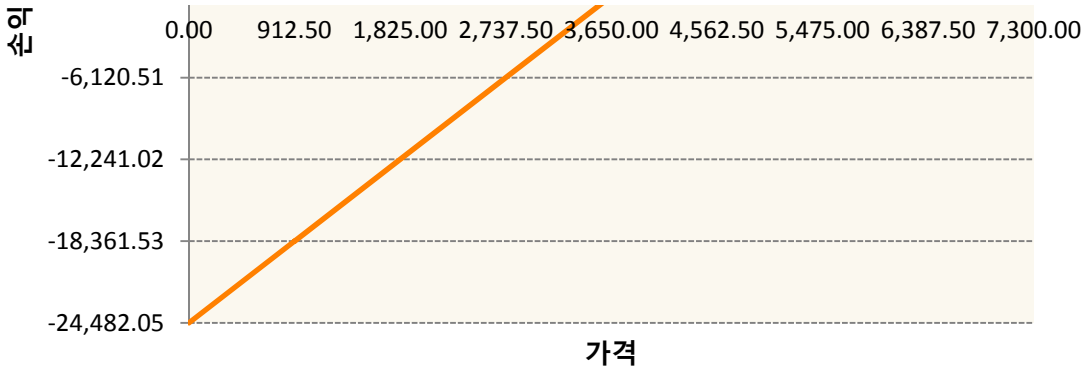


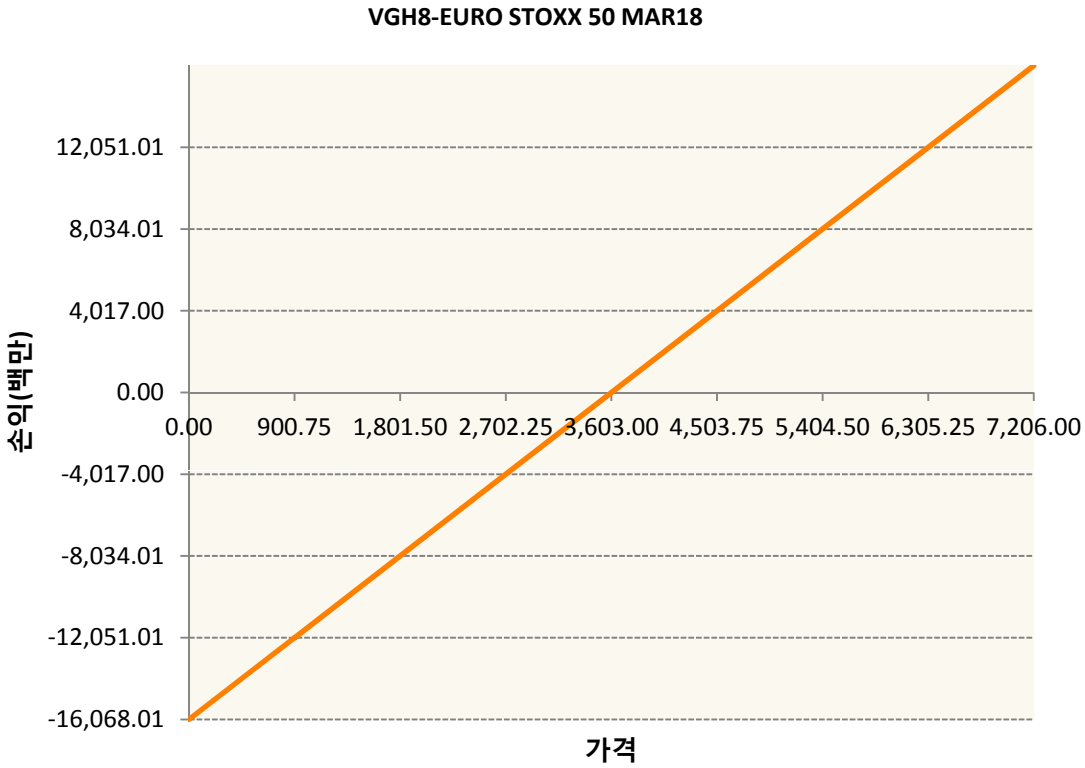
OESXG8-P3625-EURO STOXX 50



OESXG8-P3650-EURO STOXX 50







3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)	(단위:백만원)
260105SGPX SG EURO Covered CALL STRATEGY - 994.569	26
260105SQPX SG EURO Covered CALL STRATEGY	49
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	77
OESXG8-C3(EURO STOXX 50	1,959
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	77
OESXG8-P3(EURO STOXX 50	1,959
VGH8 EURO STOXX 50 MAR18	1,285

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준)	(단위:백만원)

2,989

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

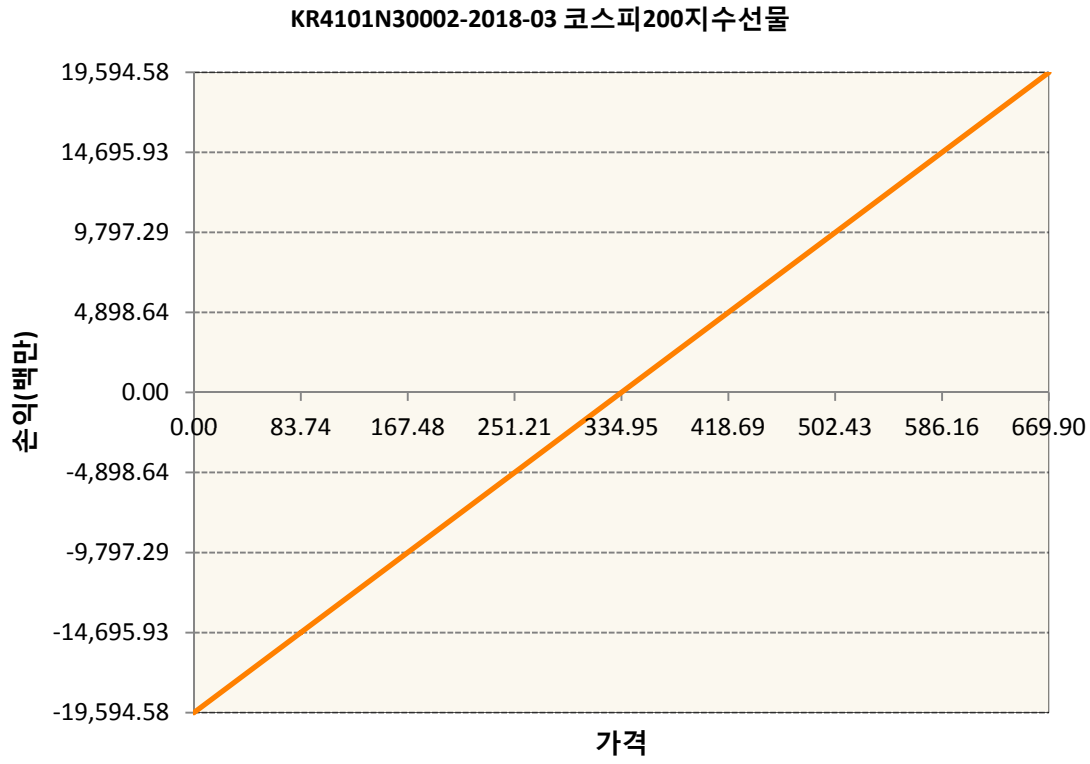
ETF스마트레버리지목표전환형8호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	1,180	-1,180	장내
누계	유가증권	선물	19,595	0	19,595	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							1,560
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560	-1,560
-5.33%	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040	-1,040
-2.67%	-520	-520	-520	-520	-520	-520	-520
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	520	520	520	520	520	520	520
5.33%	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040	1,040
8.00%	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560	1,560

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

945

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

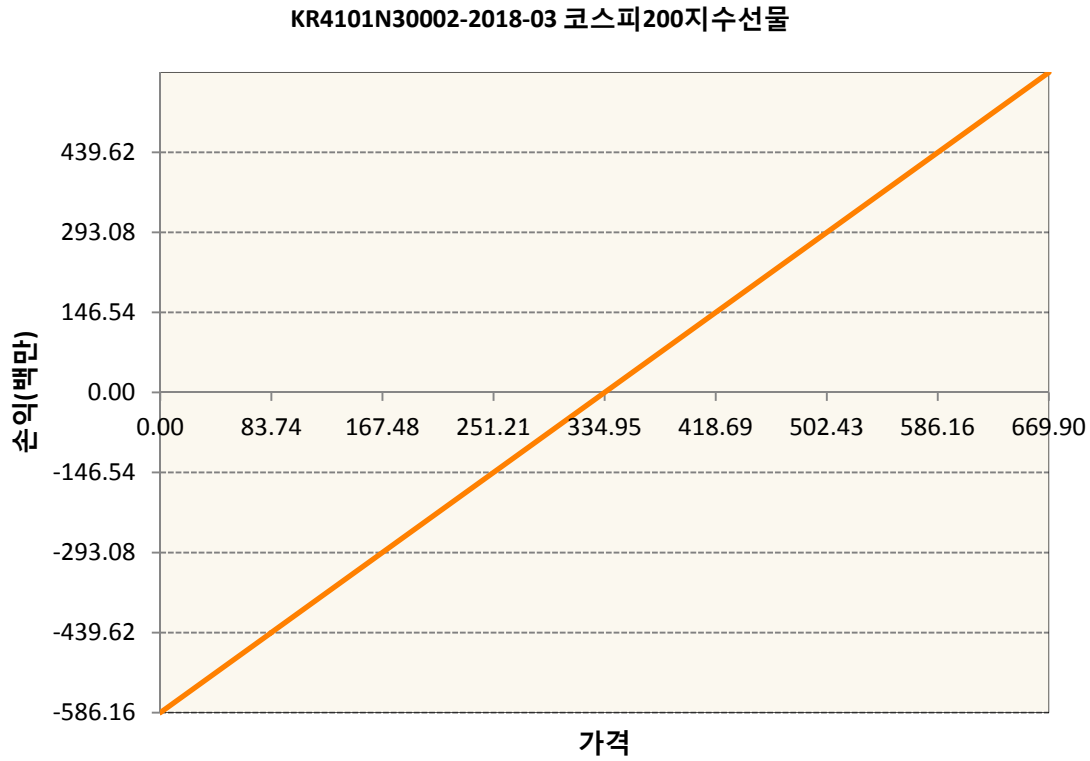
ETF스마트레버리지목표전환형9호

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	586	0	586	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							47
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-47	-47	-47	-47	-47	-47	-47
-5.33%	-31	-31	-31	-31	-31	-31	-31
-2.67%	-16	-16	-16	-16	-16	-16	-16
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	16	16	16	16	16	16	16
5.33%	31	31	31	31	31	31	31
8.00%	47	47	47	47	47	47	47

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

28

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

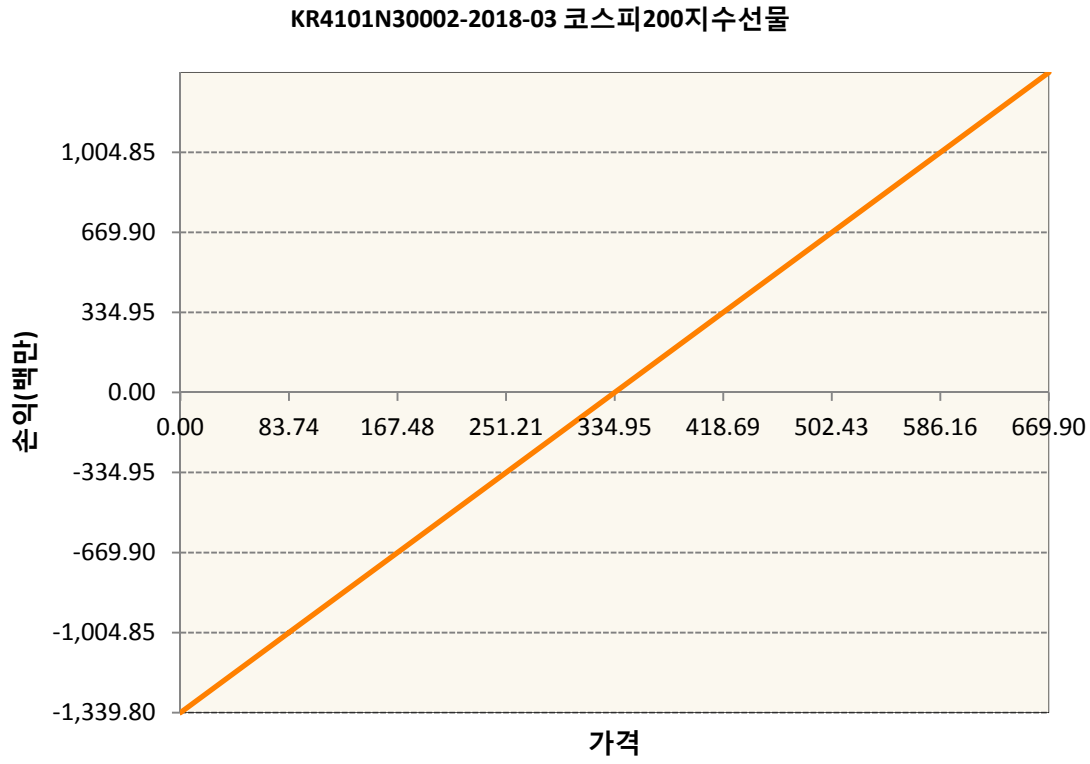
ETF스마트레버리지목표전환형10

1. 계약금액

(단위:백만원)

구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	장내
누계	유가증권	선물	1,340	0	1,340	장내

2. 만기시점의 손익구조



3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)

(단위:백만원)

KR4101N30(2018-03 코스피200지수선물							107
	기초자산의 변동성						
가격	-25.00%	-16.67%	-8.33%	0%	8.33%	16.67%	25.00%
-8.00%	-107	-107	-107	-107	-107	-107	-107
-5.33%	-71	-71	-71	-71	-71	-71	-71
-2.67%	-36	-36	-36	-36	-36	-36	-36
0%	0	0	0	0	0	0	0
2.67%	36	36	36	36	36	36	36
5.33%	71	71	71	71	71	71	71
8.00%	107	107	107	107	107	107	107

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

65

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

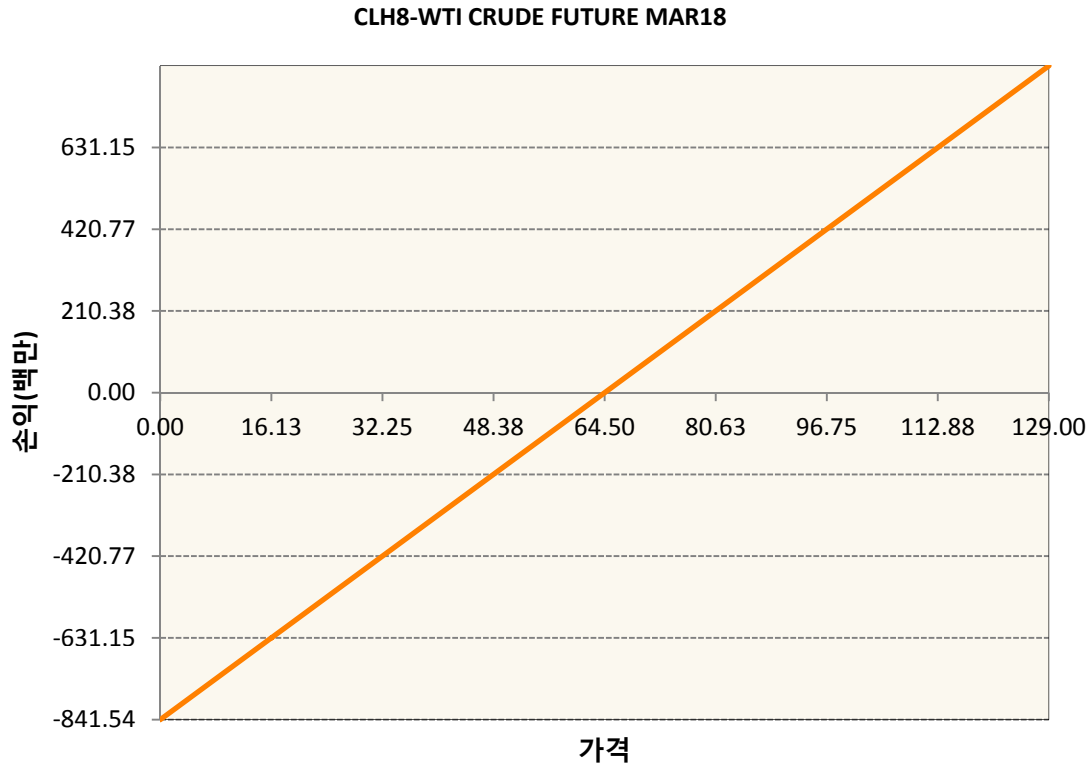
에너지인덱스플러스모(채권-파생형)

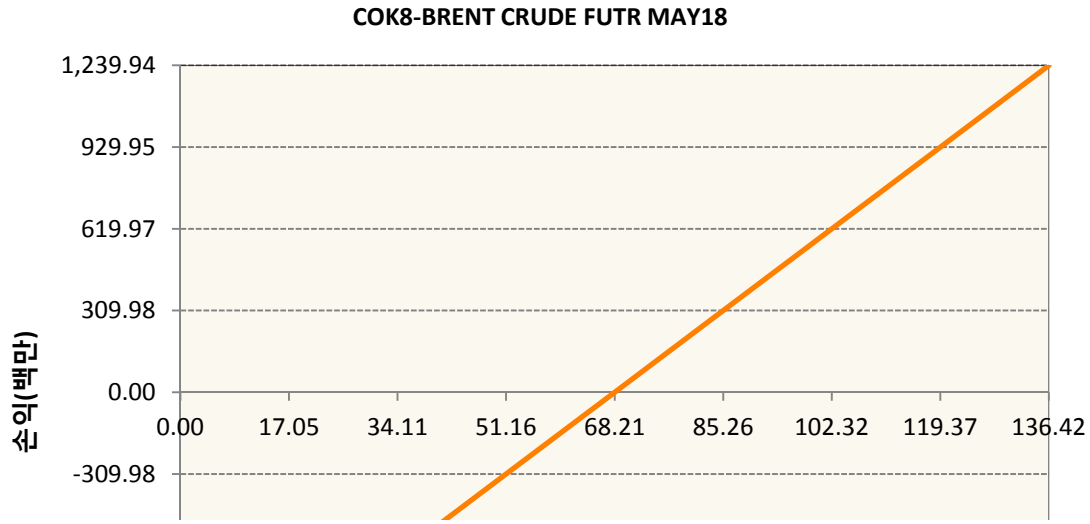
1. 계약금액

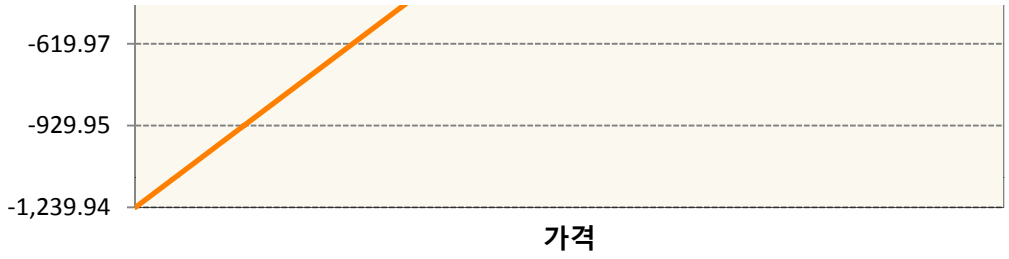
(단위:백만원)

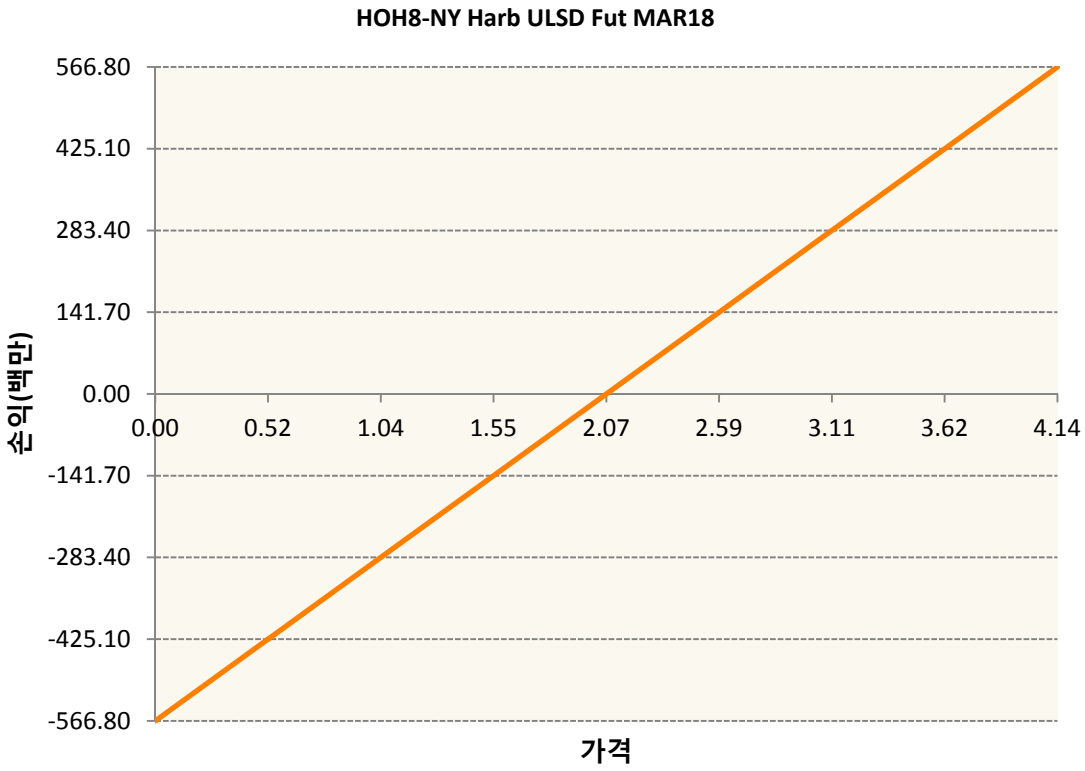
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,562	854	3,708	

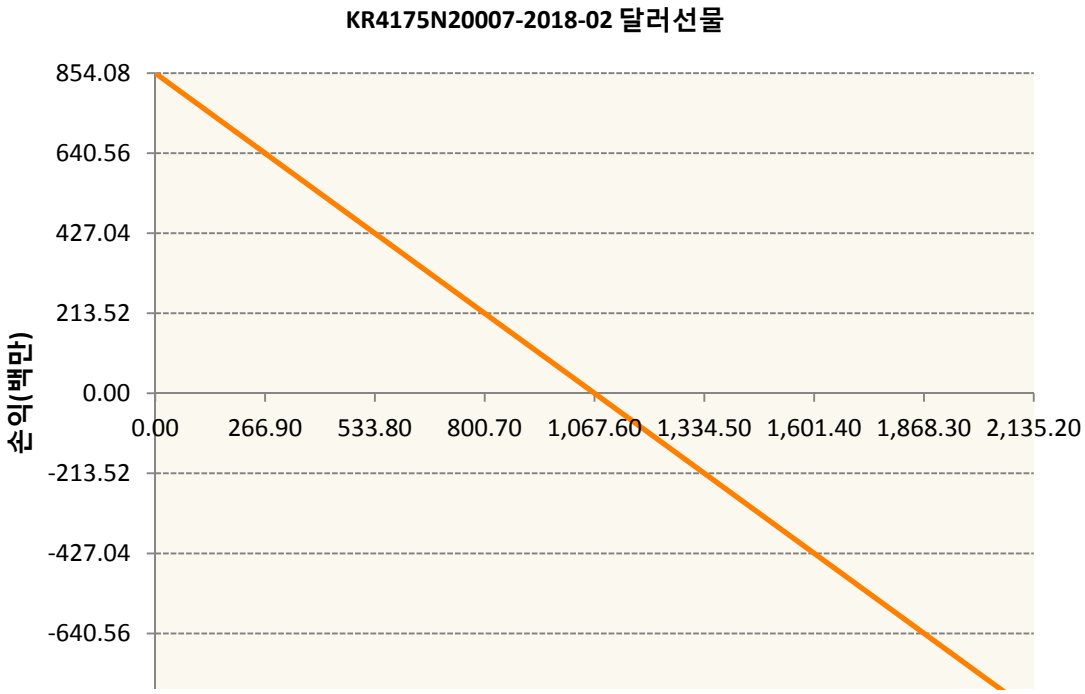
2. 만기시점의 손익구조

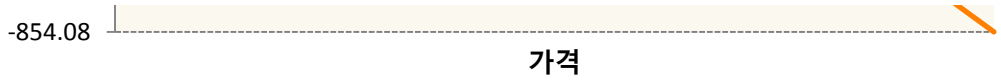


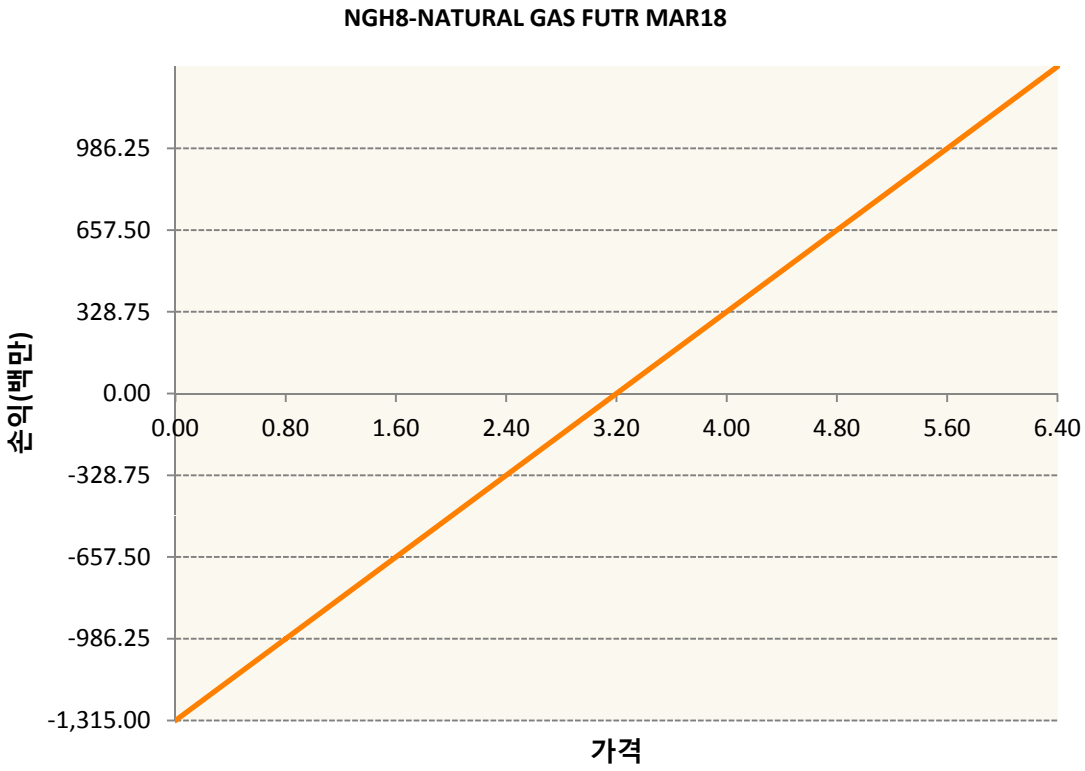


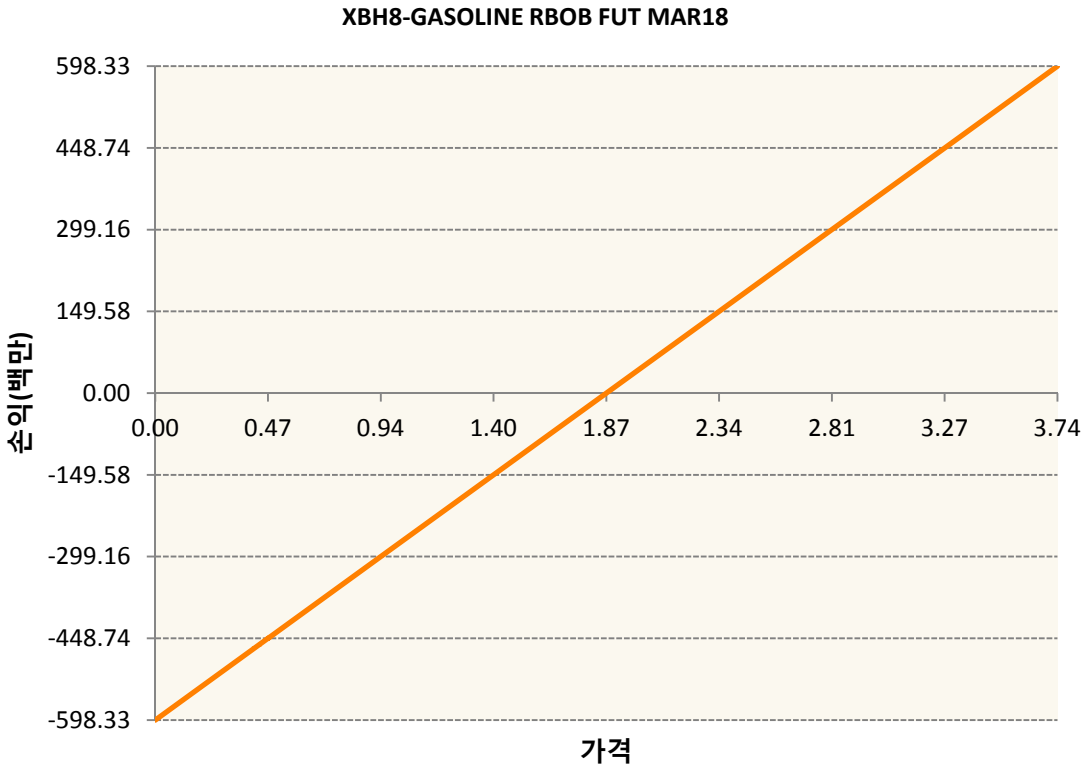

-619.97
-929.95
-1,239.94
가격


HOH8-NY Harb ULSD Fut MAR18
566.80
425.10
283.40
141.70
0.00
-141.70
-283.40
-425.10
-566.80
0.00
0.52
1.04
1.55
2.07
2.59
3.11
3.62
4.14
손익(백만)
가격


KR4175N20007-2018-02 달러선물
854.08
640.56
427.04
213.52
0.00
-213.52
-427.04
-640.56
0.00
266.90
533.80
800.70
1,067.60
1,334.50
1,601.40
1,868.30
2,135.20
손익(백만)


-854.08
가격


NGH8-NATURAL GAS FUTR MAR18
986.25
657.50
328.75
0.00
-328.75
-657.50
-986.25
-1,315.00
0.00
0.80
1.60
2.40
3.20
4.00
4.80
5.60
6.40
손익(백만)
가격


XBH8-GASOLINE RBOB FUT MAR18
598.33
448.74
299.16
149.58
0.00
-149.58
-299.16
-448.74
-598.33
0.00
0.47
0.94
1.40
1.87
2.34
2.81
3.27
3.74
손익(백만)
가격

3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액) (단위:백만원)

CLH8	WTI CRUDE FUTURE MAR18	67
COK8	BRENT CRUDE FUTR MAY18	99
HOH8	NY Harb ULSD Fut MAR18	45
KR4175N20(	2018-02 달러선물	68
NGH8	NATURAL GAS FUTR MAR18	105
XBH8	GASOLINE RBOB FUT MAR18	48

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

625

공시일	2018-02-01
기준일	2018-01-31

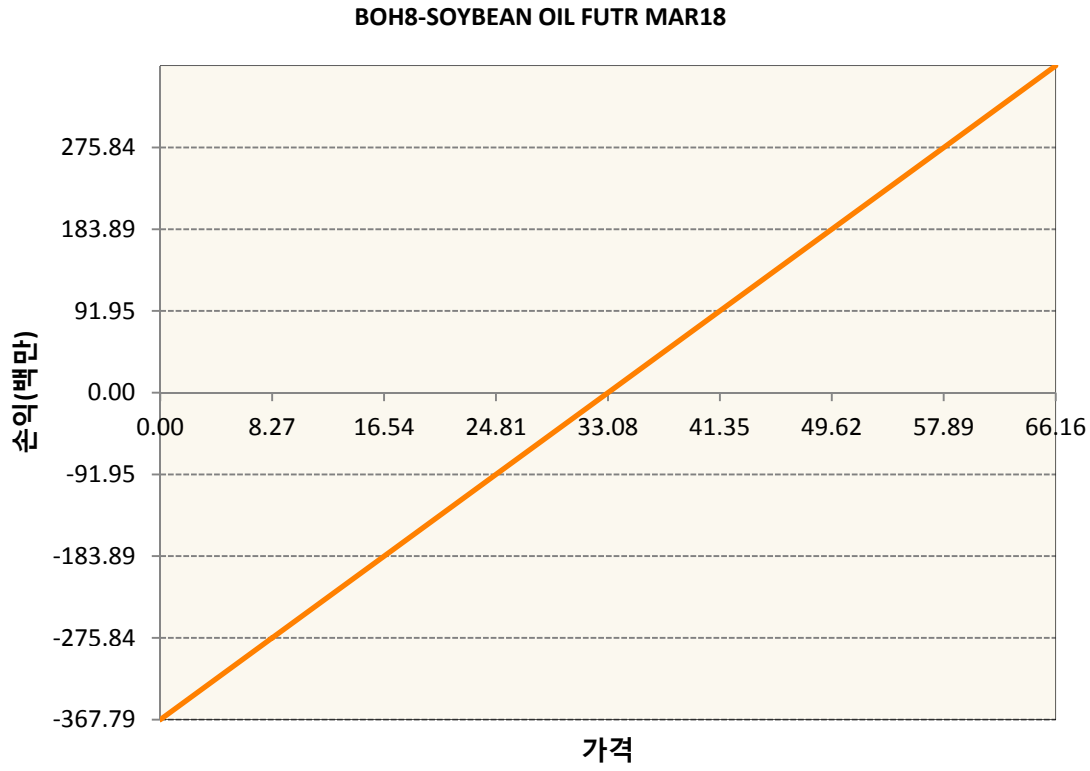
애그리컬쳐인덱스플러스모(채권-파생형)

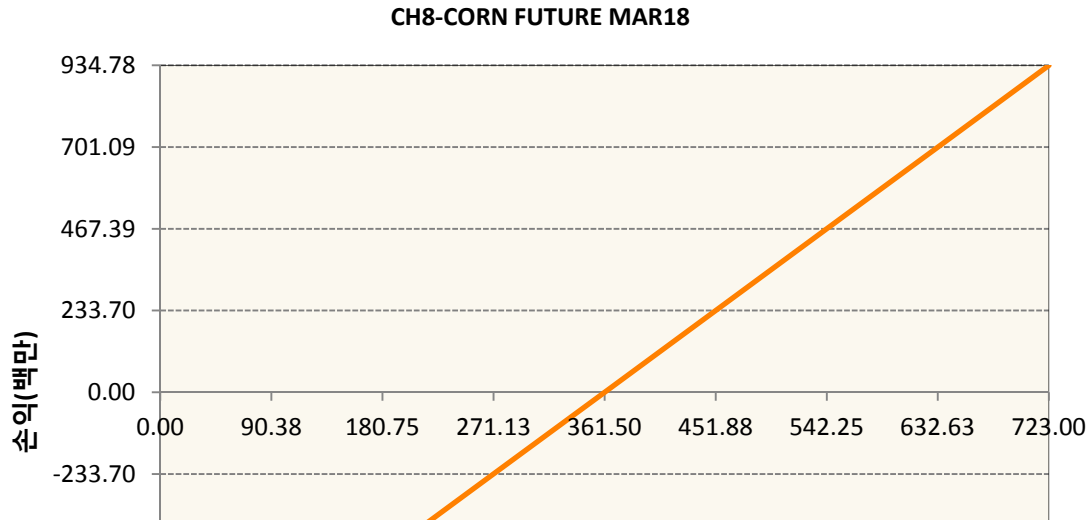
1. 계약금액

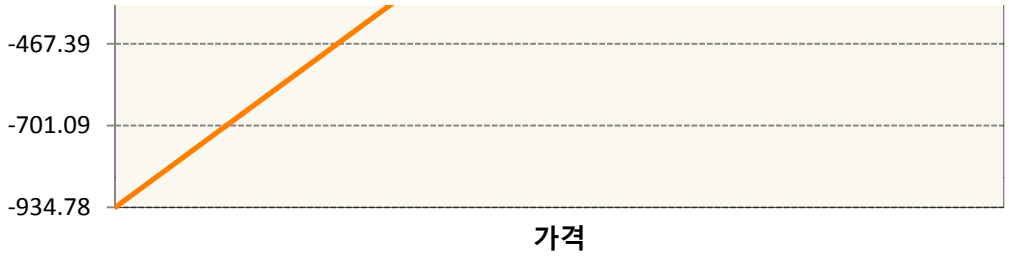
(단위:백만원)

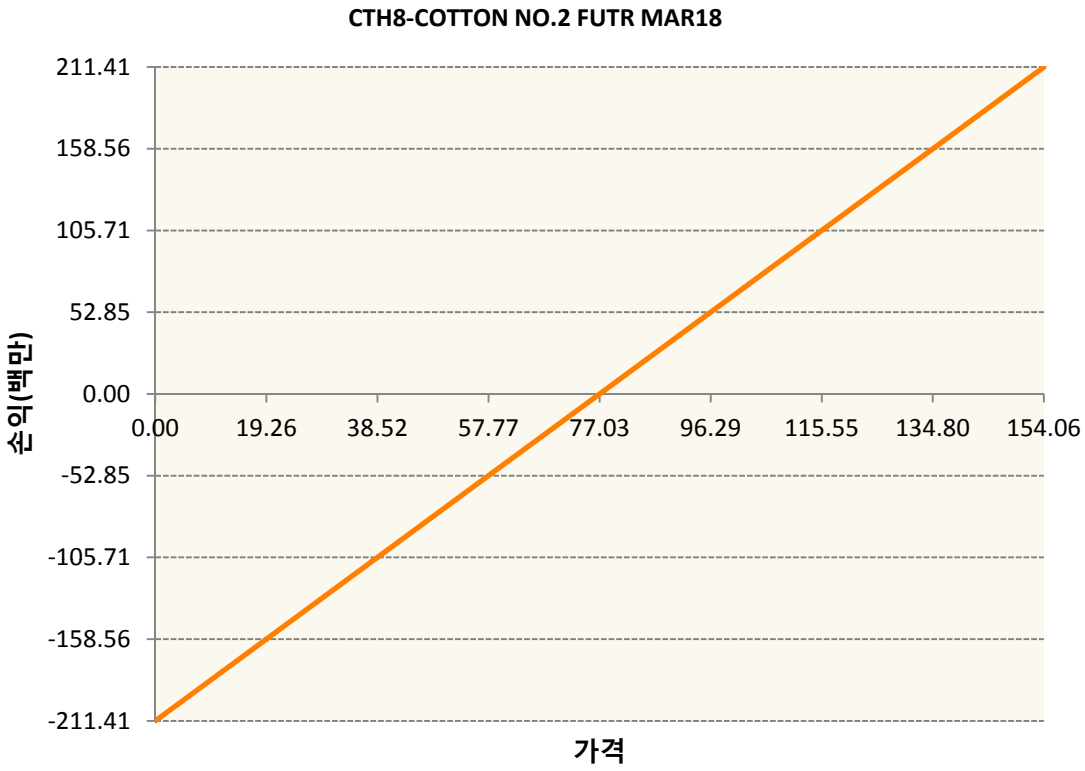
구분	거래대상	거래유형	매수(1)	매도(2)	순포지션(1-2)	비고
신규	유가증권	선물	0	0	0	
누계	유가증권	선물	4,177	320	3,856	

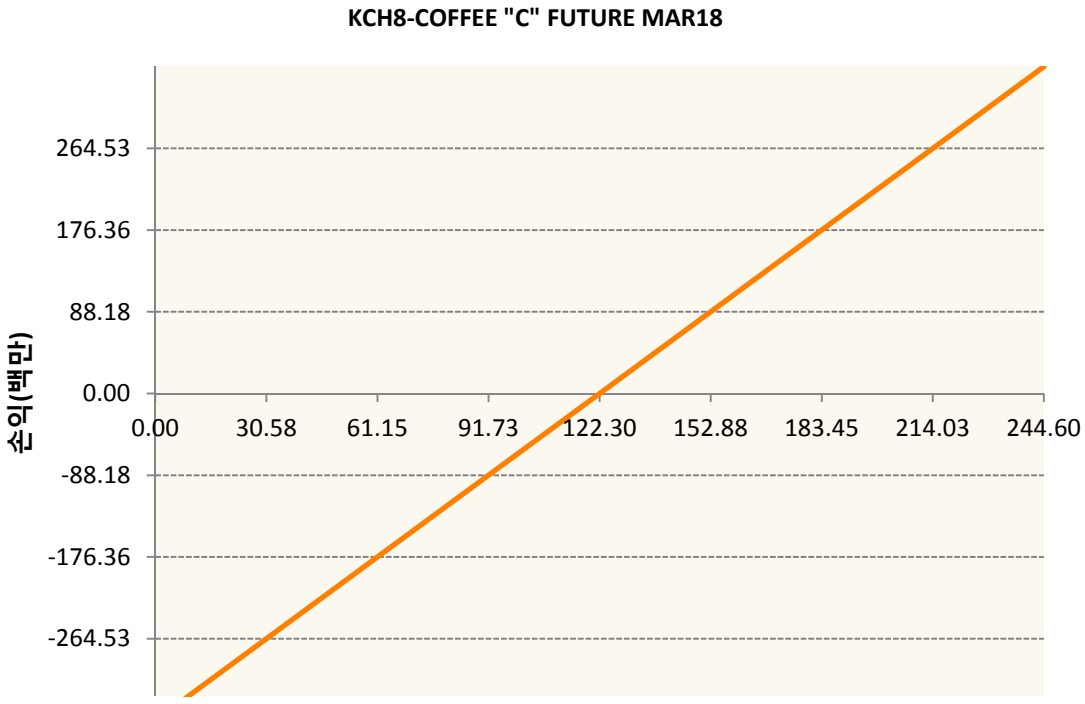
2. 만기시점의 손익구조

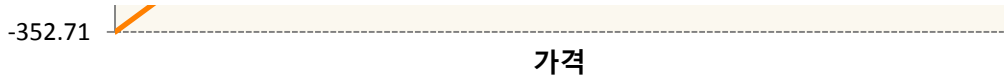


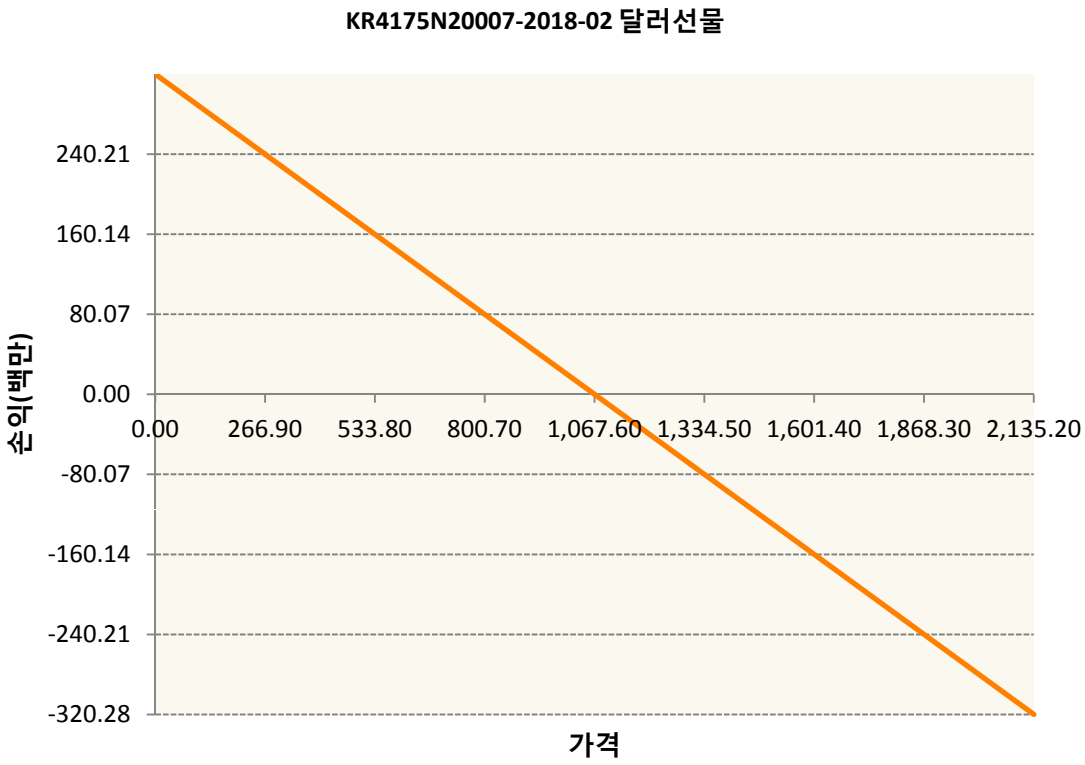


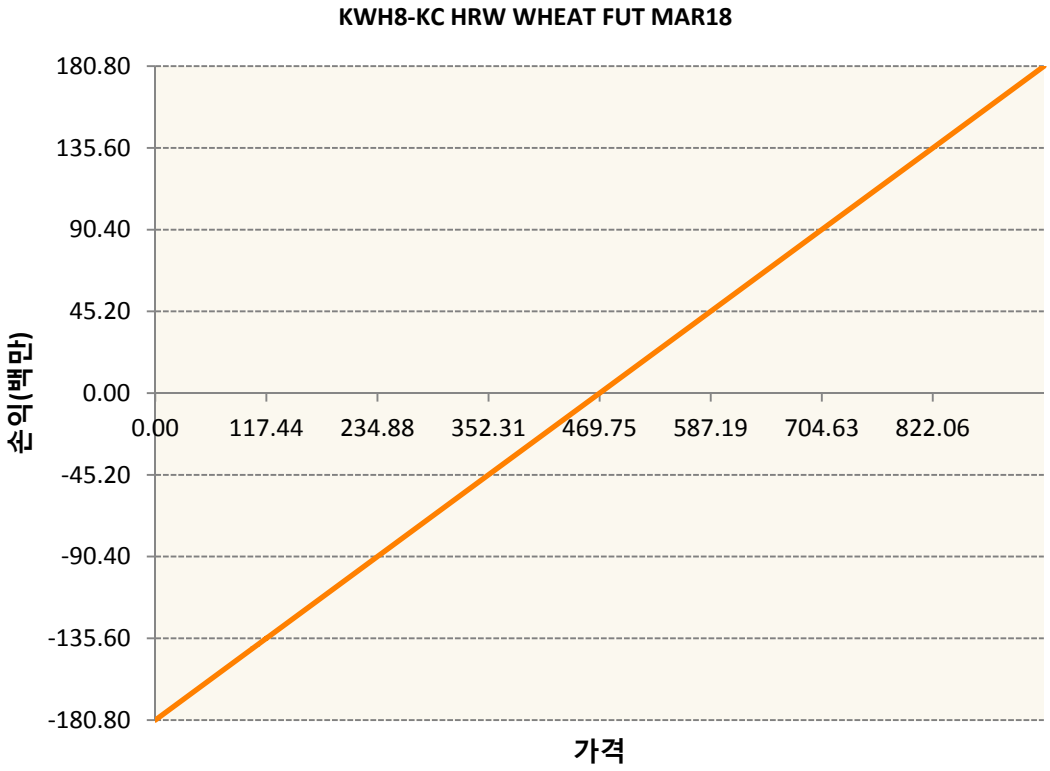

-467.39
-701.09
-934.78
가격

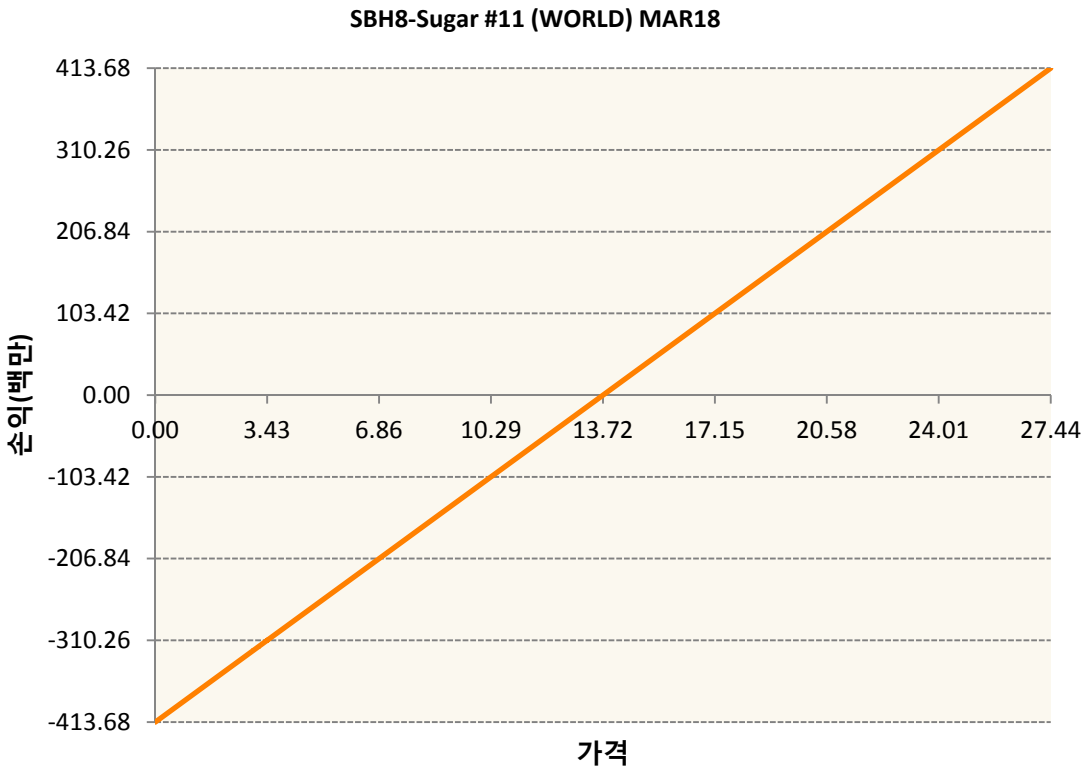

CTH8-COTTON NO.2 FUTR MAR18
211.41
158.56
105.71
52.85
0.00
-52.85
-105.71
-158.56
-211.41
손익(백만)
0.00
19.26
38.52
57.77
77.03
96.29
115.55
134.80
154.06
가격

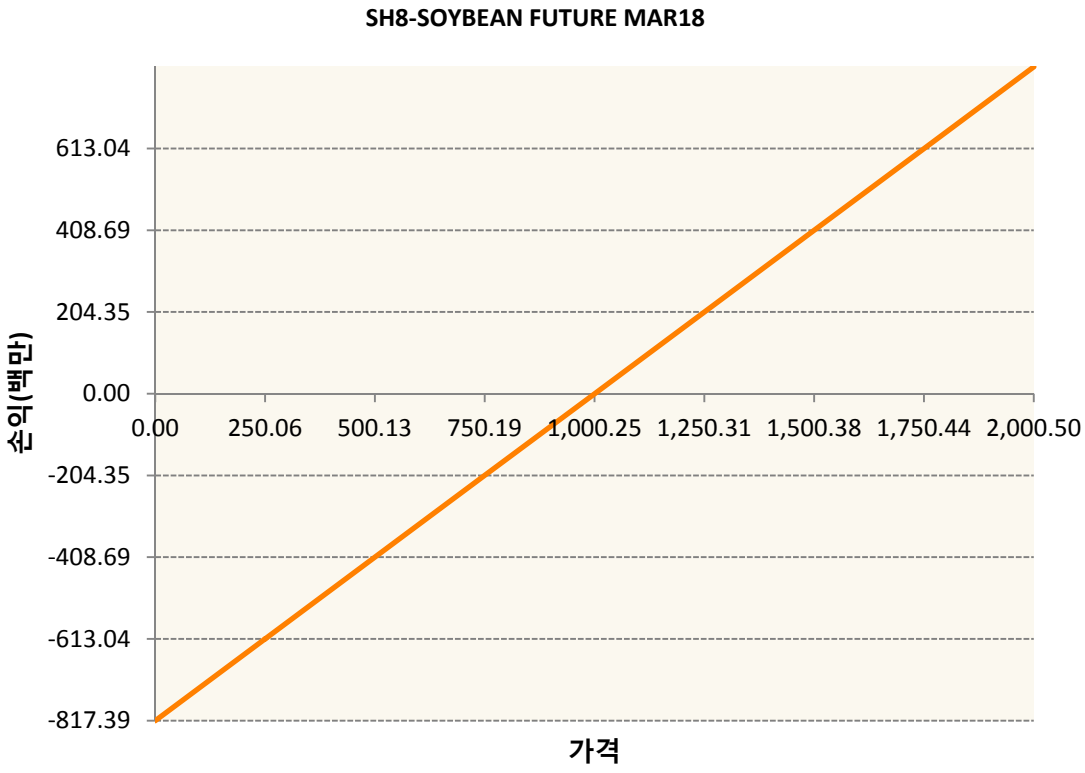

KCH8-COFFEE "C" FUTURE MAR18
264.53
176.36
88.18
0.00
-88.18
-176.36
-264.53
손익(백만)
0.00
30.58
61.15
91.73
122.30
152.88
183.45
214.03
244.60


-352.71
가격

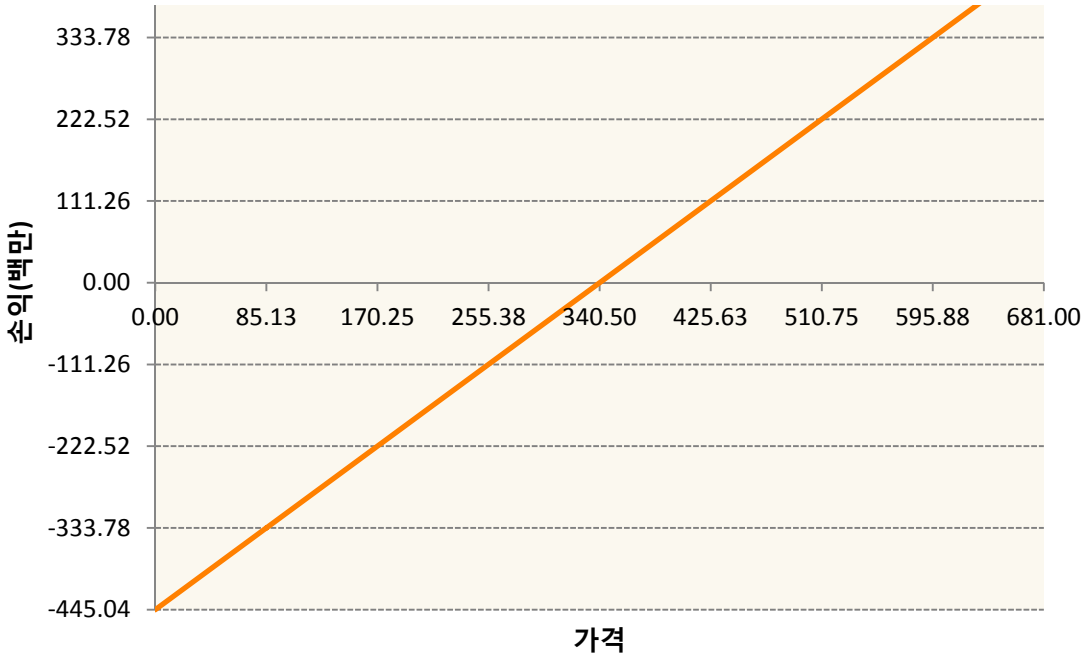

KR4175N20007-2018-02 달러선물
240.21
160.14
80.07
0.00
-80.07
-160.14
-240.21
-320.28
0.00
266.90
533.80
800.70
1,067.60
1,334.50
1,601.40
1,868.30
2,135.20
손익(백만)
가격

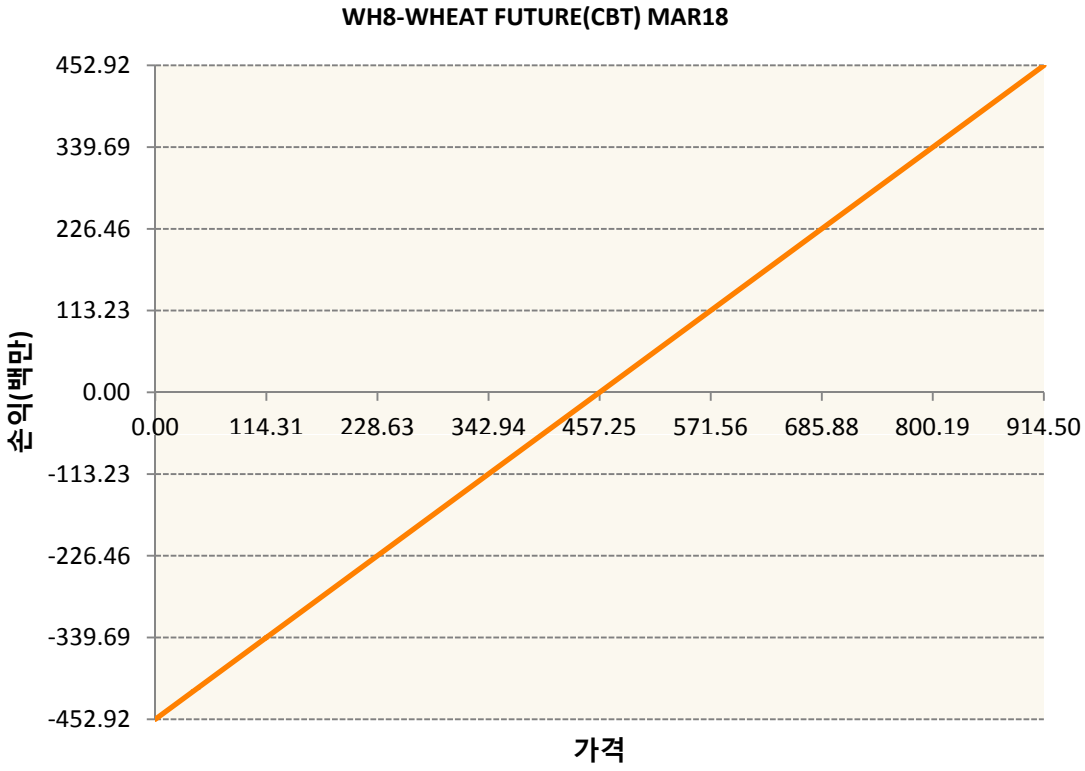

KWH8-KC HRW WHEAT FUT MAR18
180.80
135.60
90.40
45.20
0.00
-45.20
-90.40
-135.60
-180.80
0.00
117.44
234.88
352.31
469.75
587.19
704.63
822.06
손익(백만)
가격


SBH8-Sugar #11 (WORLD) MAR18
413.68
310.26
206.84
103.42
0.00
-103.42
-206.84
-310.26
-413.68
손익(백만)
0.00
3.43
6.86
10.29
13.72
17.15
20.58
24.01
27.44
가격


SH8-SOYBEAN FUTURE MAR18
613.04
408.69
204.35
0.00
-204.35
-408.69
-613.04
-817.39
손익(백만)
0.00
250.06
500.13
750.19
1,000.25
1,250.31
1,500.38
1,750.44
2,000.50
가격


SMH8-SOYBEAN MEAL FUTR MAR18





3. 시나리오별 손익구조변동(최대손실예상금액)		(단위:백만원)
BOH8	SOYBEAN OIL FUTR MAR18	29
CH8	CORN FUTURE MAR18	75
CTH8	COTTON NO.2 FUTR MAR18	17
KCH8	COFFEE "C" FUTURE MAR18	28
KR4175N20(	2018-02 달러선물	26

KWH8	KC HRW WHEAT FUT MAR18	14
SBH8	Sugar #11 (WORLD) MAR18	33
SH8	SOYBEAN FUTURE MAR18	65
SMH8	SOYBEAN MEAL FUTR MAR18	36
WH8	WHEAT FUTURE(CBT) MAR18	36

4. 파생상품의 최대손실예상금액(VaR : 99%신뢰수준,10일기준) (단위:백만원)

348